

# SSGA SPDR ETFs Europe I plc

## Rapport annuel et États financiers audités pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

À l'intention des investisseurs suisses

Une société d'investissement à capital variable constituée en Irlande avec responsabilité limitée dont le numéro d'enregistrement est le 493329 et établie en tant que fonds à compartiments multiples à responsabilité séparée entre ses compartiments conformément à la Réglementation de 2011 sur les OPCVM (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières) (telle qu'amendée) (la « Réglementation OPCVM »).

## Sommaire

|  | <b>Page</b> |
|--|-------------|
| Administration de la Société   | 1           |
| Informations de base sur la Société  | 3           |
| Rapport des Administrateurs  | 13          |
| Rapport du Dépositaire aux Actionnaires  | 17          |
| Rapports des Gestionnaires d'investissement  | 18          |
| Rapport des Commissaires aux comptes   | 25          |
| États financiers de la Société   | 33          |
| SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF  | 37          |
| SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF  | 64          |
| SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF  | 88          |
| SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF                                       | 94          |
| SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF   | 100         |
| SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF                                       | 107         |
| SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF   | 148         |
| SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF   | 163         |
| SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF  | 207         |
| SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF  | 220         |
| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF   | 233         |
| SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF   | 394         |
| SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF  | 400         |
| SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF   | 410         |
| SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF   | 416         |
| SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF   | 429         |
| SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF                                  | 478         |
| SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF  | 493         |
| SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF  | 502         |
| SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF   | 508         |
| SPDR MSCI ACWI UCITS ETF   | 520         |
| SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF  | 556         |
| SPDR MSCI EMU UCITS ETF  | 572         |
| SPDR MSCI Japan UCITS ETF  | 580         |
| SPDR MSCI World UCITS ETF  | 588         |
| SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF  | 611         |
| SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF   | 621         |
| SPDR S&P 500 UCITS ETF   | 629         |
| SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF  | 640         |
| SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF                                     | 646         |
| SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF   | 652         |
| SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF   | 658         |
| SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF   | 665         |
| SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF   | 672         |
| SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF   | 678         |
| Notes aux États financiers   | 685         |
| Annexe I – Politique de rémunération (non auditée)   | 789         |
| Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité)                   | 791         |
| Annexe III – Informations à fournir en vertu des Règlements SFDR et taxinomie (non auditées) | 844         |

## Administration de la Société

### Société de gestion, Gestionnaire d'investissement et Distributeur mondial

State Street Global Advisors Europe Limited  
78 Sir John Rogerson's Quay  
Dublin D02 HD32  
Irlande

### Administrateurs

M. Tom Finlay\* (irlandais) (démissionnaire au 16 mars 2023)  
M. Patrick J. Riley\* (américain) (démissionnaire au 16 mars 2023)  
Mme Barbara Healy\* (irlandaise)  
Mme Kathleen Gallagher (australienne)  
Mme Ellen Needham (américaine) (démissionnaire au 1<sup>er</sup> mai 2023)  
Mme Jennifer Fox\* (irlandaise) (nommée le 16 mars 2023)  
M. Tom Coghlan\* (irlandais) (nommé le 25 juillet 2023)

\* Administrateurs indépendants

### Siège social

78 Sir John Rogerson's Quay  
Dublin D02 HD32  
Irlande

### Gestionnaires d'investissement par délégation

State Street Global Advisors Limited  
20 Churchill Place  
Canary Wharf  
London E14 5HJ  
Royaume-Uni

State Street Global Advisors Trust Company (anciennement une branche de State Street Bank & Trust Company)

Channel Center  
1 Iron Street  
Massachusetts 02210  
États-Unis

State Street Global Advisors Singapore Limited  
168 Robinson Road #33-01 Capital Tower  
Singapore, 068912  
Singapour

### Conseil d'administration de la Société de gestion

Nigel Wightman (britannique)  
Ann Prendergast (irlandaise)  
Eric Linnane (irlandais)  
Scott Sanderson (britannique)  
Margaret Cullen (irlandaise)  
Ulla Pitha (américaine) (démissionnaire au 30 juin 2022)  
Patrick Mulvihill (irlandais)  
Marie-Anne Heeren (belge) (nommée le 7 septembre 2022)

### Agent administratif, Agent de transfert et Agent de registre

State Street Fund Services (Ireland) Limited  
78 Sir John Rogerson's Quay  
Dublin D02 HD32  
Irlande

### Distributeur délégué

State Street Global Advisors Limited  
20 Churchill Place  
Canary Wharf  
London E14 5HJ  
Royaume-Uni

### Dépositaire

State Street Custodial Services (Ireland) Limited  
78 Sir John Rogerson's Quay  
Dublin D02 HD32  
Irlande

### Secrétaire de la Société

Matsack Trust Limited  
70 Sir John Rogerson's Quay  
Dublin D02 R296  
Irlande

### Conseillers juridiques en Irlande

Matheson  
70 Sir John Rogerson's Quay  
Dublin D02 R296  
Irlande

### Commissaire aux comptes indépendant

Ernst & Young  
Chartered Accountants & Statutory Auditors  
EY Building  
Harcourt Centre  
2 Harcourt Street  
Dublin D02 YA40  
Irlande

### Agent payeur suisse

State Street Bank International GmbH  
Brienner Strasse 59  
80333 Munich  
Allemagne

### Représentant en Suisse

State Street Bank International GmbH  
München  
Zweigniederlassung Zürich  
Beethovenstrasse 19  
Postfach  
8027 Zürich  
Suisse

**Agent payeur en Suisse**

State Street Bank International GmbH  
München  
Zweigniederlassung Zürich  
Beethovenstrasse 19  
Postfach  
8027 Zürich  
Suisse

Il est possible de se procurer sans frais le prospectus, le document d'informations clés (DIC) et les statuts constitutifs de la société, les rapports annuels et semestriels ainsi que la liste de l'ensemble des acquisitions et cessions réalisées au cours de la période considérée auprès du représentant en Suisse, State Street Bank International GmbH, München, Zweigniederlassung Zürich, Beethovenstrasse 19, Postfach, 8027 Zürich



## Informations de base sur la Société

SSGA SPDR ETFs Europe I plc (la « Société ») a été immatriculée le 5 janvier 2011 sous le numéro 493329 et opère en Irlande en tant que société à responsabilité limitée de type *public limited company* sous le régime du *Companies Act* de 2014. Elle a été agréée par la Banque centrale d'Irlande (la « Banque centrale ») le 7 mars 2011.

La Société est une société d'investissement à capital variable de type ouvert agréée par la Banque centrale en vertu de la Réglementation des Communautés européennes (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières) de 2011, dans sa version amendée, et elle est agréée et réglementée par la Banque centrale en vertu de la Réglementation (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières) de 2019 issue de la Réglementation intitulée *Central Bank (Supervision and Enforcement) Act* (Section 48(1)) de 2013 (la « Réglementation OPCVM »).

Les actifs nets sous gestion de la Société au 31 mars 2023 s'élevaient à 46 187 960 717 USD (31 mars 2022 : 45 338 821 760 USD et 31 mars 2021 : 43 417 992 366 USD). Les actifs nets sous gestion de chaque Compartiment sont détaillés ci-dessous et la Valeur liquidative par action publiée est déclarée dans l'État de la situation financière de chaque Compartiment.

| Compartiment  | Date de lancement des Compartiments actifs | Devise fonctionnelle | Actifs nets 2023 | Actifs nets 2022 | Actifs nets 2021 |
|---|--|----------------------|------------------|------------------|------------------|
| SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF       | 27 août 2013                               | EUR                  | 1 786 232 864    | 1 744 346 817    | 2 008 982 347    |
| SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF       | 27 août 2013                               | USD                  | 181 701 560      | 125 082 374      | 72 507 032       |
| SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF                   | 17 juillet 2019                            | USD                  | 260 093 179      | 115 258 246      | 406 803 060      |
| SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF      | 14 novembre 2011                           | EUR                  | 626 811 951      | 710 641 809      | 1 192 545 296    |
| SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF        | 27 août 2013                               | USD                  | 94 999 764       | 139 326 141      | 140 528 405      |
| SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF      | 17 février 2016                            | USD                  | 161 073 458      | 70 649 142       | 70 748 066       |
| SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF        | 13 mai 2011                                | USD                  | 2 610 834 106    | 3 031 391 954    | 3 508 742 471    |
| SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF                | 23 mai 2011                                | EUR                  | 471 674 285      | 543 323 720      | 582 518 566      |
| SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF               | 23 mai 2011                                | EUR                  | 1 039 285 554    | 1 102 387 542    | 1 328 658 848    |
| SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF               | 3 février 2012                             | EUR                  | 433 301 952      | 556 738 259      | 967 954 931      |
| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF              | 26 janvier 2018                            | USD                  | 2 662 392 801    | 1 915 056 166    | 1 955 613 232    |
| SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF                          | 2 décembre 2015                            | USD                  | 355 364 147      | 416 609 080      | 487 684 620      |
| SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF                 | 3 juin 2011                                | USD                  | 488 890 539      | 521 968 554      | 480 800 488      |
| SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF                | 10 novembre 2021                           | USD                  | 19 839 663       | 30 207 918       | -                |
| SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF            | 19 octobre 2020                            | EUR                  | 73 125 051       | 70 465 426       | 91 089 556       |
| SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF            | 23 octobre 2020                            | USD                  | 6 837 154 765    | 6 906 062 739    | 5 426 286 814    |
| SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF | 19 septembre 2013                          | USD                  | 193 400 544      | 136 076 249      | 151 265 179      |
| SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF                 | 23 octobre 2012                            | USD                  | 253 433 722      | 341 275 764      | 245 380 426      |
| SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF           | 10 août 2015                               | EUR                  | 34 230 251       | 62 045 127       | 59 481 064       |

La Société est une société d'investissement à compartiments multiples et responsabilité séparée entre ses compartiments (chacun un « Compartiment ») et collectivement les « Compartiments ») et tout passif engagé pour le compte d'un Compartiment ou attribuable à un quelconque Compartiment sera donc exclusivement acquitté sur les actifs de ce dernier. La Société est composée à ce jour de cinquante-cinq Compartiments actifs comportant différentes catégories d'actions.

## Informations de base sur la Société (suite)

| Compartiment   | Date de lancement des Compartiments actifs | Devise fonctionnelle | Actifs nets 2023              | Actifs nets 2022 | Actifs nets 2021 |
|--|--|----------------------|-------------------------------|------------------|------------------|
| SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF                       | 28 février 2012                            | GBP                  | 680 098 555                   | 670 452 336      | 807 561 197      |
| SPDR MSCI ACWI UCITS ETF                                 | 13 mai 2011                                | USD                  | 2 636 854 813                 | 3 190 283 021    | 2 846 437 201    |
| SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF                              | 13 mai 2011                                | USD                  | 1 029 820 170                 | 1 134 298 007    | 1 490 232 394    |
| SPDR MSCI EMU UCITS ETF                                  | 25 janvier 2013                            | EUR                  | 220 897 751                   | 230 281 186      | 294 646 299      |
| SPDR MSCI Japan UCITS ETF                                | 30 novembre 2015                           | JPY                  | 40 963 042 299 33 299 177 101 | 11 561 861 863   |                  |
| SPDR MSCI World UCITS ETF                                | 28 février 2019                            | USD                  | 2 241 569 269                 | 1 444 937 436    | 743 807 270      |
| SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF                      | 30 janvier 2012                            | USD                  | 1 638 049 757                 | 1 343 780 516    | 1 070 202 543    |
| SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF*                      | 2 décembre 2019                            | USD                  | 751 261 957                   | 572 196 332      | 349 508 280      |
| SPDR S&P 500 UCITS ETF                                   | 19 mars 2012                               | USD                  | 5 302 631 228                 | 6 399 472 867    | 5 517 430 538    |
| SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF                    | 3 octobre 2012                             | USD                  | 155 080 425                   | 185 140 640      | 206 872 889      |
| SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF | 14 octobre 2011                            | USD                  | 129 142 623                   | 102 239 702      | 150 563 497      |
| SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF             | 28 février 2012                            | EUR                  | 1 217 145 492                 | 1 093 860 854    | 1 491 082 538    |
| SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF           | 14 mai 2013                                | USD                  | 1 188 448 051                 | 1 205 711 772    | 716 525 350      |
| SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF         | 14 mai 2013                                | USD                  | 135 256 088                   | 157 571 731      | 213 861 155      |
| SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF             | 28 février 2012                            | GBP                  | 124 703 051                   | 124 630 119      | 109 013 832      |
| SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF             | 14 octobre 2011                            | USD                  | 4 909 897 281                 | 3 927 777 533    | 2 959 196 052    |

\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

Des Compartiments pourront être établis en tant que de besoin.

## Informations de base sur la Société (suite)

### Conflit russo-ukrainien

Le conflit entre la Russie et l'Ukraine, qui a débuté le 24 février 2022, a donné lieu à de nombreuses restrictions et perturbations impactant les valeurs mobilières et les marchés russes. Les effets de ces restrictions ont affecté et sont susceptibles d'affecter encore les Compartiments exposés aux marchés russes. Les menaces de sanctions ou celles déjà imposées à l'encontre de la Russie, d'entités russes ou de particuliers russes peuvent entraîner une perturbation de l'économie du pays, provoquer une volatilité sur d'autres marchés régionaux et mondiaux et avoir une incidence négative sur les performances de divers secteurs et industries, ainsi que sur les sociétés d'autres pays, ce qui pourrait générer un effet préjudiciable sur les performances d'un Compartiment, même si ce dernier n'a pas d'exposition directe aux titres d'émetteurs russes. En raison, à la fois, de l'imposition des sanctions, des mesures de représailles du gouvernement russe et de l'impact que ces deux facteurs ont eu sur les marchés de titres russes, certains Compartiments ont eu recours à des procédures de valorisation approuvées par le Conseil d'administration de la Société pour certains titres russes dont la valeur pourrait, le cas échéant, avoir été estimée à zéro. Les compartiments détiennent des positions insignifiantes sur les titres russes. Les sanctions, ou la menace de nouvelles sanctions, voire de sanctions remaniées, pourraient également entraver la capacité d'un Compartiment à acheter, vendre, détenir, recevoir, livrer ou effectuer d'autres transactions sur certains titres ou autres instruments d'investissement concernés. Au 31 mars 2023, le Compartiment SPDR MSCI ACWI UCITS ETF détenait des titres russes et a par conséquent été impacté par les décisions prises au regard de sa juste valeur.

## Informations de base sur la Société (suite)

Les Compartiments actifs de la Société sont cotés sur les Bourses de valeurs suivantes au 31 mars 2023\* :

|  | Deutsche<br>Borse | London<br>Stock<br>Exchange | Euronext<br>Paris | SIX<br>Swiss | Borsa<br>Italiana | Euronext<br>Amsterdam | Cboe<br>NL | Mexico<br>Stock<br>Exchange |
|--|-------------------|-----------------------------|-------------------|--------------|-------------------|-----------------------|------------|-----------------------------|
| SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF  | Oui               | Oui                         | Oui               | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF  | Oui               | Oui                         | -                 | Oui          | Oui               | -                     | Oui        | -                           |
| SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF              | Oui               | -                           | -                 | Oui          | -                 | -                     | -          | Oui                         |
| SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF | Oui               | Oui                         | Oui               | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF   | Oui               | Oui                         | -                 | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF | Oui               | Oui                         | -                 | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF   | Oui               | Oui                         | Oui               | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF           | Oui               | -                           | Oui               | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF          | Oui               | -                           | -                 | Oui          | Oui               | Oui                   | -          | -                           |
| SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF          | Oui               | Oui                         | Oui               | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF         | Oui               | Oui                         | -                 | Oui          | Oui               | -                     | -          | Oui                         |
| SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF                     | Oui               | Oui                         | -                 | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF            | Oui               | Oui                         | Oui               | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF           | Oui               | Oui                         | -                 | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF       | Oui               | -                           | -                 | Oui          | Oui               | Oui                   | -          | -                           |

## Informations de base sur la Société (suite)

|   | Deutsche<br>Borse | London<br>Stock<br>Exchange | Euronext<br>Paris | SIX<br>Swiss | Borsa<br>Italiana | Euronext<br>Amsterdam | Cboe<br>NL | Mexico<br>Stock<br>Exchange |
|---|-------------------|-----------------------------|-------------------|--------------|-------------------|-----------------------|------------|-----------------------------|
| SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF            | Oui               | Oui                         | -                 | Oui          | Oui               | Oui                   | -          | Oui                         |
| SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF | Oui               | Oui                         | -                 | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF                 | Oui               | Oui                         | -                 | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF           | Oui               | -                           | -                 | Oui          | -                 | -                     | -          | -                           |
| SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF                          | Oui               | Oui                         | -                 | Oui          | -                 | -                     | -          | -                           |
| SPDR MSCI ACWI UCITS ETF                                    | Oui               | Oui                         | Oui               | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF                                 | Oui               | Oui                         | Oui               | Oui          | Oui               | -                     | -          | Oui                         |
| SPDR MSCI EMU UCITS ETF                                     | Oui               | -                           | Oui               | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR MSCI Japan UCITS ETF                                   | Oui               | Oui                         | Oui               | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR MSCI World UCITS ETF                                   | Oui               | Oui                         | -                 | Oui          | Oui               | Oui                   | -          | -                           |
| SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF                         | Oui               | Oui                         | Oui               | Oui          | Oui               | -                     | -          | Oui                         |
| SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF**                        | Oui               | -                           | -                 | Oui          | Oui               | Oui                   | -          | -                           |
| SPDR S&P 500 UCITS ETF                                      | Oui               | Oui                         | Oui               | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF                       | Oui               | Oui                         | Oui               | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF    | Oui               | Oui                         | -                 | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF                | Oui               | Oui                         | Oui               | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF              | Oui               | Oui                         | -                 | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF            | Oui               | Oui                         | -                 | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |
| SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF                | Oui               | Oui                         | -                 | Oui          | -                 | -                     | -          | -                           |
| SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF                | Oui               | Oui                         | -                 | Oui          | Oui               | -                     | -          | -                           |

\* Les catégories d'actions ne sont pas toutes cotées sur chaque Bourse de valeurs.

\*\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

## Informations de base sur la Société (suite)

### OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

#### SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance du marché des obligations d'entreprise à courte échéance, à taux fixe, de qualité *investment grade* et libellées en euros. La politique d'investissement du Compartiment est de répliquer la performance du Bloomberg Euro 0-3 Year Corporate Bond Index (ou de tout autre indice déterminé à la discrétion des Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que le Bloomberg Euro 0-3 Year Corporate Bond Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice ») le plus fidèlement possible, tout en cherchant à minimiser, autant que possible, l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance du marché des obligations d'entreprise à courte échéance, à taux fixe, de qualité *investment grade* et libellées en dollars américains. La politique d'investissement du Compartiment est de répliquer la performance du Bloomberg U.S. 0-3 Year Corporate Bond Index (ou de tout autre indice déterminé à la discrétion des Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que le Bloomberg U.S. 0-3 Year Corporate Bond Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice ») le plus fidèlement possible, tout en cherchant à minimiser, autant que possible, l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance du marché des bons du Trésor américain à court terme. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice Bloomberg U.S. Treasury Bills 1-3 Month Index (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice Bloomberg U.S. Treasury Bills 1-3 Month Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'Indice), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance du marché des obligations d'État à courte échéance de la zone euro. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance du Bloomberg 1-3 Year Euro Treasury Bond Index (ou de tout autre indice déterminé à la discrétion des Administrateurs pour répliquer substantiellement de temps à autre le même marché que l'indice Bloomberg 1-3 Year Euro Treasury Bond Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser, autant que possible, l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance du marché des obligations du Trésor américain à courte échéance. La politique d'investissement du Compartiment est de répliquer la performance du Bloomberg U.S. 1-3 Year Treasury Bond Index (ou de tout autre indice déterminé à la discrétion des Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que le Bloomberg U.S. 1-3 Year Treasury Bond Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice ») le plus fidèlement possible, tout en cherchant à minimiser, autant que possible, l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance du marché des obligations d'entreprise d'échéance intermédiaire à taux fixe, de qualité *investment grade* et libellées en dollars américains. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance du Bloomberg U.S. Intermediate Corporate Bond Index (ou de tout autre indice déterminé à la discrétion des Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que le Bloomberg U.S. Intermediate Corporate Bond Index et que les Administrateurs estiment adéquat pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser l'écart de performance entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance des obligations des marchés émergents en devise locale éligibles à l'investissement. La politique d'investissement du Compartiment est de répliquer la performance de l'indice Bloomberg EM Local Currency Liquid Government Bond Index (ou de tout autre indice déterminé à la discrétion des Administrateurs pour suivre substantiellement le même marché que l'indice Bloomberg Emerging Markets Local Currency Liquid Government Bond Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (« l'Indice ») le plus fidèlement possible, tout en cherchant à minimiser autant que possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance du marché des obligations à taux fixe, de qualité *investment grade* et libellées en euros. La politique d'investissement du Compartiment est de répliquer la performance du Bloomberg Euro Aggregate Bond Index (ou de tout autre indice déterminé à la discrétion des Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que le Bloomberg Euro Aggregate Bond Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice ») le plus fidèlement possible, tout en cherchant à minimiser l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

## Informations de base sur la Société (suite)

### OBJECTIF D'INVESTISSEMENT (suite)

#### SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance du marché des obligations d'État de la zone euro. La politique d'investissement du Compartiment est de répliquer la performance du Bloomberg Euro Treasury Bond Index (ou de tout autre indice déterminé à la discrétion des Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que le Bloomberg Euro Treasury Bond Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice ») le plus fidèlement possible, tout en cherchant à minimiser l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance du marché des obligations d'entreprise à haut rendement, à taux fixe et libellées en euros. La politique d'investissement du Compartiment est de répliquer la performance du Bloomberg Liquidity Screened Euro High Yield Bond Index (ou de tout autre indice déterminé ponctuellement par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que le Bloomberg Liquidity Screened Euro High Yield Bond Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice ») le plus fidèlement possible, tout en cherchant à minimiser l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance du marché des obligations mondiales à taux fixe de qualité *investment grade*. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance du Bloomberg Global Aggregate Bond Index (ou de tout autre indice déterminé à la discrétion des Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que le Bloomberg Global Aggregate Bond Index et que ces derniers estiment adéquat pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser l'écart de performance entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance du marché des obligations d'État américaines indexées sur l'inflation (également appelées *Treasury Inflation Protected Securities* ou « TIPS »). La politique d'investissement du Compartiment est de répliquer la performance du Bloomberg Barclays U.S. Government Inflation-Linked Bond Index (ou de tout autre indice déterminé à la discrétion des Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que le Bloomberg Barclays U.S. Government Inflation-Linked Bond Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice ») le plus fidèlement possible, tout en cherchant à minimiser, autant que possible, l'écart de performance entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance du marché des bons du Trésor américain. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance du Bloomberg U.S. Treasury Bond Index (ou de tout autre indice déterminé à la discrétion des Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que le Bloomberg U.S. Treasury Bond Index et que ces derniers estiment adéquat pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment est de répliquer la performance du marché des bons du Trésor chinois. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance du Bloomberg China Treasury 100BN Index (ou de tout autre indice déterminé à la discrétion des Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que le Bloomberg China Treasury 100BN Index et que ces derniers estiment adéquat pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment est de répliquer la performance du marché des obligations d'entreprise à taux fixe, de qualité *investment grade* et libellées en euros. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice Bloomberg SASB Euro Corporate ESG Ex-Controversies Select Index (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice Bloomberg SASB Euro Corporate ESG Ex-Controversies Select Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment est de répliquer la performance du marché des obligations d'entreprise imposables à taux fixe de qualité *investment grade* et libellées en dollars américains. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG Ex-Controversies Select Index (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG Ex-Controversies Select Index et jugé approprié par les Administrateurs pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

## Informations de base sur la Société (suite)

### OBJECTIF D'INVESTISSEMENT (suite)

#### SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance du marché des obligations d'entreprise à haut rendement, à court terme et à taux fixe, libellées en dollars américains. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice Bloomberg SASB US Corporate High Yield ESG Ex-Controversies Select Index (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice Bloomberg SASB US Corporate High Yield ESG Ex-Controversies Select Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance du marché mondial des valeurs immobilières cotées. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice Dow Jones Global Select Real Estate Securities Index (« RESI ») (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que le RESI et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance du marché des valeurs immobilières cotées en Europe. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice FTSE EPRA/NAREIT Developed Europe ex-UK Index (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice FTSE EPRA/NAREIT Developed Europe ex-UK Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'ensemble du marché d'actions britannique. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice FTSE All-Share Index (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice FTSE All-Share Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance des marchés d'actions des pays développés et émergents. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice MSCI ACWI (All Country World Index) Index (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice MSCI ACWI (All Country World Index) Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance des marchés d'actions des pays émergents d'Asie. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice MSCI EM (« Emerging Markets ») Asia Index (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice MSCI Emerging Markets Asia Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.



## Informations de base sur la Société (suite)

### OBJECTIF D'INVESTISSEMENT (suite)

#### SPDR MSCI EMU UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance des titres de participation émis par des sociétés de grande et moyenne capitalisation de pays développés de la zone euro. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice MSCI EMU Index (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice MSCI EMU Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR MSCI Japan UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance du marché d'actions japonais. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice MSCI Japan Index (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice MSCI Japan Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR MSCI World UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance des actions de sociétés de grande et moyenne taille situées dans des marchés développés du monde entier. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice MSCI Japan Index (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice MSCI Japan Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance des entreprises américaines de taille moyenne. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice S&P Mid Cap 400 Index (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice S&P Mid Cap 400 Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF\*

L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance du marché des titres de participation de sociétés américaines de grande capitalisation. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice S&P 500 ESG Leaders Index (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice S&P 500 ESG Leaders Index), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

#### SPDR S&P 500 UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance du marché des titres de participation de sociétés américaines de grande capitalisation. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice S&P 500 Index (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice S&P 500 Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance des titres de participation de sociétés américaines de grande capitalisation qui ont affiché par le passé des caractéristiques de faible volatilité. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice S&P 500 Low Volatility Index (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice S&P 500 Low Volatility Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance des marchés d'actions à dividendes élevés des marchés émergents. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice S&P Emerging Markets High Yield Dividend Aristocrats Index (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice S&P Emerging Markets High Yield Dividend Aristocrats Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

## Informations de base sur la Société (suite)

### OBJECTIF D'INVESTISSEMENT (suite)

#### SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance de certains titres de participation à dividendes élevés émis par des sociétés de la zone euro. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice S&P Euro High Yield Dividend Aristocrats Index (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice S&P Euro High Yield Dividend Aristocrats Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance des actions à dividendes élevés à l'échelle mondiale. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice S&P Global Dividend Aristocrats Quality Income Index (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice S&P Global Dividend Aristocrats Quality Income Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance des actions à dividendes élevés de la région Asie-Pacifique. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice S&P Pan Asia Dividend Aristocrats Index (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice S&P Pan Asia Dividend Aristocrats Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance de certains titres de participation à haut rendement boursier émis par des sociétés du Royaume-Uni. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice S&P U.K. High Yield Dividend Aristocrats Index (ou de tout autre indice déterminé à la discrétion des Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice S&P U.K. High Yield Dividend Aristocrats Index et que ces derniers estiment adéquat pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

#### SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF

L'objectif d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance de certains titres de participation à dividendes élevés du marché américain. La politique d'investissement du Compartiment vise à répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice S&P High Yield Dividend Aristocrats Index (ou de tout autre indice déterminé en tant que de besoin par les Administrateurs pour répliquer substantiellement le même marché que l'indice S&P High Yield Dividend Aristocrats Index et jugé approprié par ces derniers pour être répliqué par le Compartiment, conformément aux dispositions du Prospectus) (l'« Indice »), tout en cherchant à minimiser dans la mesure du possible l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice.

## Rapport des Administrateurs

Les Administrateurs présentent ici le rapport annuel et les États financiers de l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023.

### Déclaration des responsabilités des Administrateurs

Les Administrateurs ont la responsabilité de préparer le Rapport des Administrateurs et les états financiers conformément à la législation irlandaise.

La législation irlandaise exige que les Administrateurs préparent les états financiers présentant une image fidèle des actifs, des passifs et de la situation financière de la Société à la clôture de l'exercice financier, ainsi que des profits et pertes de la Société pour l'exercice financier. Au titre de ladite législation, les Administrateurs ont préparé les états financiers conformément aux Normes internationales d'information financière (« IFRS ») adoptées par l'Union européenne (« UE »).

En vertu du droit irlandais, les Administrateurs ne sauraient approuver les états financiers sous réserve qu'ils répondent à l'obligation de présenter une image fidèle des actifs, des passifs, des passifs et de la situation financière de la Société à la clôture de l'exercice financier, ainsi que des profits et pertes de la Société pour l'exercice financier.

Lors de la préparation de ces états financiers, les Administrateurs sont ainsi tenus :

- de sélectionner des conventions comptables pertinentes et les appliquer de manière systématique ;
- d'exprimer leur avis et de présenter des estimations raisonnables et prudentes ;
- de préciser si les états ont été préparés conformément aux Normes IFRS et de s'assurer qu'ils présentent les informations complémentaires requises au titre du *Companies Act* de 2014 ; et
- de préparer des états financiers sur la base du principe de la continuité d'exploitation, sauf s'il n'est pas approprié de penser que la Société poursuivra ses activités.

Les Administrateurs confirment qu'ils ont observé les exigences précitées lors de la préparation des états financiers.

Les états financiers ont été préparés selon le principe de la continuité d'exploitation, car les Administrateurs estiment que la Société peut poursuivre son existence opérationnelle sur une période d'au moins douze mois à compter de la date d'approbation des présents états financiers (« la période d'évaluation »). Les Administrateurs estiment que les actifs financiers continueront à générer des flux de trésorerie suffisants pour honorer les engagements de la Société à leur échéance. Dans le cadre de cette évaluation, les Administrateurs ont pris en compte l'impact potentiel du conflit russo-ukrainien sur l'activité de la Société au cours de la période d'évaluation.

Les Administrateurs sont responsables de la tenue de registres comptables appropriés qui soient suffisants pour :

- correctement enregistrer et justifier les transactions de la Société ;
- permettre de déterminer, à tout moment et avec précision raisonnable, les actifs, les passifs, la situation financière ainsi que les profits et pertes de la Société ; et

- permettre aux Administrateurs de garantir que les états financiers sont conformes au *Companies Act* de 2014, et permettre que ces états financiers fassent l'objet d'un audit.

Les Administrateurs sont responsables de la sauvegarde des actifs de la Société. À cet égard, ils ont confié les actifs de la Société à State Street Custodial Services (Ireland) Limited (« le Dépositaire ») qui a été nommé Dépositaire de la Société conformément aux termes d'un Contrat de Dépositaire. Les Administrateurs ont la responsabilité générale de prendre toutes les mesures qui s'offrent à eux pour prévenir et détecter les fraudes et autres irrégularités.

Les états financiers sont publiés sur le site Internet [ssga.com](https://www.ssga.com). Les Administrateurs, ainsi que le Gestionnaire d'investissement, sont responsables de l'actualisation et de l'intégrité des informations financières publiées sur ce site internet. La législation de la République d'Irlande régissant la préparation et la diffusion des états financiers peut différer des législations des autres juridictions.

Le présent Rapport annuel et les États financiers audités (les « Rapports et comptes ») peuvent être traduits dans d'autres langues. Toute traduction contiendra strictement les mêmes informations et aura la même signification que le Rapport et les comptes en anglais. En cas de contradictions entre le Rapport et les comptes originaux rédigés en langue anglaise et l'une de leurs traductions, la version originale anglaise prévaudra, à l'exception exclusive des cas où les lois en vigueur dans une juridiction où les parts sont vendues imposent que dans le cadre de toute action intentée sur la base des informations communiquées dans l'une des versions traduites, la langue concernée prévaudra. Les litiges quant aux termes du Rapport et des comptes, quelle que soit la langue dans laquelle ils sont rédigés, seront réputés régis et interprétés conformément à la législation irlandaise.

### Informations d'audit pertinentes

À la connaissance des Administrateurs, il n'existe aucune information d'audit pertinente dont les Commissaires aux comptes de la Société n'auraient pas connaissance, et les Administrateurs ont pris toutes les mesures qui relèvent de leurs responsabilités d'administrateurs afin de s'assurer qu'ils ont connaissance de toutes les informations d'audit pertinentes et que les Commissaires aux comptes de la Société ont connaissance de ces informations.

### Registres comptables

Les Administrateurs s'assurent que la Société se conforme à son obligation de tenir des registres comptables adéquats, en confiant à des personnes compétentes la responsabilité desdits registres. Les registres comptables sont conservés par State Street Fund Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin D02 HD32, Irlande.

### Évaluation de l'activité et évolutions futures

La Société est une société d'investissement à capital variable autorisée par la Banque centrale et régie par la Réglementation OPCVM. Les principales activités et les objectifs d'investissement des Compartiments sont stipulés sous la section « Informations de base sur la Société ». Les Rapports des Gestionnaires d'investissement comprennent une analyse de marché ainsi que les performances réalisées par les Compartiments.

## Rapport des Administrateurs (suite)

### Registres comptables (suite)

#### Évaluation de l'activité et évolutions futures (suite)

Les détails relatifs à la Valeur liquidative et à la Valeur liquidative par Action sont fournis dans l'État de la situation financière de chaque Compartiment et ceux relatifs au Ratio du total des frais sur encours sont indiqués en Note 3.

La nature de l'activité de la Société n'a subi aucun changement pendant l'exercice financier.

#### Objectifs et politiques de gestion des risques

Les principaux risques liés aux instruments financiers de la Société sont le risque de marché, le risque de taux d'intérêt, le risque de liquidité et le risque de crédit. Les risques non financiers comprennent le risque de gestion, le risque géopolitique/de perturbation du marché, le risque lié aux matières premières, le risque de concentration, le risque de conflits d'intérêts et le risque lié au conflit russo-ukrainien. Pour plus d'informations sur les objectifs et les politiques de gestion des risques, veuillez vous reporter à la Note 11 des présents états financiers ainsi qu'au Prospectus et aux Suppléments de la Société. S'agissant du conflit russo-ukrainien, veuillez vous reporter à la section « Informations de base sur la Société » des présents états financiers ainsi qu'à la Note 17.

### Déclaration de gouvernance d'entreprise

#### Principes généraux

La Société est soumise aux dispositions du *Companies Act* de 2014 et de la Réglementation OPCVM tels qu'applicables à la Société.

La Réglementation des Communautés européennes (Directive 2006/46/CE) (I. S. 450 de 2009 et 83 de 2010) (la « Réglementation ») exige qu'une déclaration de gouvernance d'entreprise soit incluse dans le Rapport des Administrateurs.

Bien qu'il n'existe pas de code de gouvernance d'entreprise statutaire spécifique qui s'applique aux organismes de placement collectif irlandais dont les parts sont admises pour être négociées sur une place boursière, la Société est soumise aux pratiques de gouvernance d'entreprise imposées par :

- (i) le *Companies Act* de 2014, lequel peut être consulté au siège social de la Société ou obtenu à l'adresse <http://www.irishstatutebook.ie/> ;
- (ii) les Statuts constitutifs de la Société, lesquels sont disponibles pour consultation au siège social de la Société ainsi qu'au Companies Registration Office en Irlande ; et
- (iii) la Banque centrale, aux termes de ses Avis OPCVM et Notes d'orientation relatives aux OPCVM, accessibles via le site Internet de la Banque centrale à l'adresse suivante : <https://www.centralbank.ie/regulation/industry-market-sectors/funds/ucits> et qui peuvent être consultées au siège social de la Société.

Le 14 décembre 2011, l'Irish Funds (« IF ») a publié un code de gouvernance d'entreprise (le « Code IF ») qui peut être volontairement adopté par les organismes de placement collectif autorisés en Irlande. Le Conseil d'administration (le « Conseil d'administration ») a accepté volontairement d'adopter le Code IF en date du 25 juillet 2013 et il est entré en vigueur à cette date. Il est à noter que le Code IF reflète des pratiques de gouvernance d'entreprise existantes imposées aux organismes de placement collectif autorisés

en Irlande, comme indiqué ci-dessus. Si le Code IF est adopté volontairement, il peut être mentionné dans le Rapport des Administrateurs conformément aux dispositions de la Réglementation des Communautés européennes (directive 2006/46/CE) (par exemple l'I.S. 450 de 2009 et l'I.S. 83 de 2010).

#### Systèmes de contrôle interne et de gestion des risques relatifs au reporting financier

Le Conseil d'administration est tenu d'établir et de maintenir des systèmes de contrôle interne et de gestion des risques adéquats pour la Société concernant le processus de reporting financier. Lesdits systèmes sont conçus pour gérer, plutôt que pour éliminer, le risque d'erreur ou de fraude, en servant les objectifs de reporting financier de la Société, et ne peuvent offrir qu'une garantie raisonnable et non absolue contre les inexactitudes ou pertes importantes.

Le Conseil d'administration a instauré des procédures permettant d'assurer que tous les documents comptables sont tenus de manière régulière et consultables sur demande, en ce compris la production des états financiers annuels et semestriels. La Société de gestion a mandaté State Street Fund Services (Ireland) Limited (l'« Agent administratif ») pour le compte de la Société afin que celui-ci tienne les livres et registres de la Société. L'Agent administratif est agréé et régi par la Banque centrale et se doit d'observer les règles imposées par la Banque centrale. La Société de gestion examine et évalue, en tant que de besoin, les pratiques de comptabilité et de communication financière habituelles de l'Agent administratif. Les états financiers annuels de la Société sont établis par l'Agent administratif et vérifiés par le Gestionnaire d'investissement. Ils doivent être approuvés par le Conseil d'administration, et les états financiers annuels et semestriels de la Société doivent, par ailleurs, être déposés auprès de la Banque centrale.

Pendant l'exercice financier auquel se rapportent les présents états financiers, le Conseil d'administration s'est chargé de l'examen et de l'approbation des états financiers conformément à la Déclaration des responsabilités des Administrateurs. Les états financiers doivent être audités par des commissaires aux comptes indépendants, lesquels communiquent annuellement leurs conclusions au Conseil d'administration. Le Conseil d'administration contrôle et évalue la prestation, les qualifications et l'indépendance des commissaires aux comptes. Dans le cadre des procédures de vérification, le Conseil d'administration se voit transmettre les présentations des parties concernées, incluant la prise en compte des normes comptables IFRS et de leur incidence sur les états financiers annuels, ainsi que les présentations et rapports relatifs à la procédure d'audit. Le cas échéant, le Conseil d'administration évalue et traite les questions significatives de comptabilité et de communication financière.

#### Relations avec les Actionnaires

La convocation et la tenue des assemblées générales des Actionnaires sont régies par les Statuts constitutifs de la Société et le *Companies Act* de 2014. Bien que les Administrateurs puissent convoquer à tout moment une assemblée générale extraordinaire de la Société, il a été demandé aux Administrateurs de convoquer la première assemblée générale annuelle (« AGA ») de la Société dans un délai de 18 mois à compter de la constitution de la Société, puis dans un délai de 15 mois à compter de la précédente AGA, étant entendu qu'une AGA doit se tenir dans un délai de six mois à compter de chaque clôture d'exercice comptable de la Société.

## Rapport des Administrateurs (suite)

### Relations avec les Actionnaires (suite)

Toute AGA ou toute assemblée convoquée aux fins de l'adoption d'une résolution spéciale doit être notifiée aux Actionnaires moyennant un préavis d'au moins 21 jours francs. Dans le cas d'une quelconque autre assemblée générale, un préavis de 14 jours doit s'appliquer, à moins que les Commissaires aux comptes de la Société et l'ensemble des Actionnaires de la Société habilités à assister et voter à l'assemblée acceptent un préavis plus court. La présence de deux Actionnaires, soit en personne soit aux termes d'une procuration, constitue un quorum à une assemblée générale. Le capital social de la Société est divisé en différentes catégories d'actions. Les droits inhérents à chaque Catégorie ou Compartiment (sauf disposition contraire spécifiée dans les conditions d'émission des Actions de ladite Catégorie ou dudit Compartiment ou bien aux présentes) pourront être modifiés, que la Société soit liquidée ou non, avec le consentement écrit des détenteurs de trois-quarts des Actions en circulation de cette Catégorie ou de ce Compartiment, ou par adoption d'une Résolution extraordinaire lors d'une assemblée générale distincte des porteurs d'Actions de cette Catégorie ou de ce Compartiment, à laquelle les dispositions des Statuts sur les assemblées générales s'appliqueront *mutatis mutandis*, sous réserve que, si un Actionnaire détient des Actions assorties de droits de vote, le quorum de ladite assemblée générale soit d'un Actionnaire porteur d'Actions assorties de droits de vote dans ladite Catégorie ou dans ledit Compartiment ou d'un Actionnaire porteur d'Actions de souscription, présent en personne ou par procuration. Nonobstant toute disposition contraire des Statuts, un Actionnaire porteur d'Actions de souscription sera habilité à recevoir, conformément aux dispositions prévues dans l'article 19 des Statuts, l'avis de convocation pour toute assemblée générale relative à une Catégorie ou un Compartiment. Cependant, l'Actionnaire porteur d'Actions de souscription pourra seulement voter aux assemblées générales relatives à une Catégorie ou un Compartiment ayant été ajournées et ce, conformément aux dispositions des Statuts.

Tout porteur d'actions de participation ou d'actions sans droit de participation, présent en personne ou représenté aux termes d'une procuration, qui vote à main levée, a un droit de vote unique. Lors d'un scrutin, tout porteur d'actions de participation, présent en personne ou représenté aux termes d'une procuration, est autorisé à un vote unique au titre de chaque action qu'il détient, et chaque porteur d'actions sans droit de participation est autorisé à un vote unique au titre de toutes les actions sans droit de participation qu'il détient. Lors d'une assemblée générale, une résolution soumise au vote de l'assemblée sera décidée à main levée à moins qu'un scrutin soit dûment requis (avant ou au moment de déclarer le résultat du vote à main levée) par la Présidence ou tout Actionnaire présent en personne ou par procuration.

Les Actionnaires peuvent décider d'adopter une résolution ordinaire ou une résolution spéciale en assemblée générale. Une résolution faite par écrit et signée par tous les Actionnaires et les porteurs d'actions sans droit de participation pour l'heure habilités à assister à une assemblée générale de la Société et à voter ladite résolution, sera également valide et effective à toutes fins comme si la résolution avait été proposée à une assemblée générale de la Société dûment convoquée et tenue.

Une résolution ordinaire de la Société (ou des Actionnaires d'un Compartiment ou d'une catégorie d'actions particuliers) requiert la majorité simple des votes exprimés par les Actionnaires votant, en personne ou aux termes d'une procuration, lors de l'assemblée à laquelle la résolution est proposée. Une résolution spéciale de la Société (ou des Actionnaires d'un Compartiment ou d'une catégorie d'actions particuliers) requiert une majorité

d'au moins 75 % des Actionnaires présents ou représentés, et votant en assemblée générale, y compris pour adopter une résolution visant à modifier les Statuts constitutifs de la Société.

### Composition et activités du Conseil d'administration

Conformément au *Companies Act* de 2014 et aux Statuts constitutifs, sauf disposition contraire qui serait adoptée en assemblée générale aux termes d'une résolution ordinaire de la Société, le nombre d'Administrateurs ne peut être inférieur à deux ni supérieur à 12. Au 31 mars 2023, le Conseil d'administration est composé de quatre Administrateurs non exécutifs, dont deux sont indépendants. Les informations concernant les Administrateurs actuels sont présentées ci-dessous, à la section « Administrateurs ».

L'activité de la Société est pilotée par les Administrateurs, lesquels exercent tous les pouvoirs de la Société dont il est exigé qu'ils soient exercés par la Société en assemblée générale en vertu du *Companies Act* de 2014 ou des Statuts constitutifs de la Société.

Le Conseil d'administration est responsable de la direction générale et de la stratégie de la Société et, à cette fin, il se réserve le pouvoir de déterminer ses objectifs à moyen et à long termes, d'examiner la performance managériale, de revoir sa structure organisationnelle et de définir ses besoins financiers dans le but d'atteindre les objectifs stratégiques. Pour s'acquitter de ces responsabilités, le Conseil d'administration se réunit quatre fois par an pour examiner les activités de la Société, traiter des questions d'importance stratégique et recevoir les rapports de la Société de gestion, de l'Agent administratif et du Dépositaire. Un Administrateur peut toutefois convoquer à tout moment une réunion des Administrateurs et, si besoin, des réunions ponctuelles en plus des quatre réunions habituelles ; le Secrétaire pourra lui aussi y procéder, selon les mêmes modalités, à la demande d'un Administrateur.

Les questions soulevées devant toute assemblée des Administrateurs seront décidées à la majorité des voix. En cas d'égalité des voix, la Présidence de la séance pendant laquelle le vote à main levée a lieu, ou au cours de laquelle le scrutin est demandé, sera autorisée à un second vote. Le quorum nécessaire à la conduite des opérations lors d'une réunion des Administrateurs est de deux Administrateurs.

Les Administrateurs ont assisté assidûment aux réunions du Conseil d'administration au cours de l'exercice financier clôturé au 31 mars 2023.

### Rapport sur la diversité

En ce qui concerne la diversité, la Société n'a aucun employé et les seules personnes qu'elle a directement engagées sont ses Administrateurs. En cas de vacance au sein du Conseil d'administration, l'objectif est d'assurer que ce dernier présente une mixité adéquate en termes d'âge, de genre et d'antécédents éducatifs et professionnels, étant entendu que tous répondent aux exigences réglementaires et que la composition globale offre l'expérience et les compétences requises. La mise en œuvre de la politique de diversité du Conseil d'administration inclut l'examen de l'équilibre des compétences, des connaissances, de l'expérience et de la diversité au sein du Conseil d'administration tel que détaillé dans le Plan de succession du Conseil d'administration. Les décisions en matière de sélection prises par le Conseil d'administration au cours de la période se sont fondées sur le mérite et ont suivi un processus de recrutement juste et non-discriminatoire.

## Rapport des Administrateurs (suite)

### Déclaration de conformité des Administrateurs

Conformément à l'article 225 du *Companies Act* de 2014, les Administrateurs :

- reconnaissent qu'ils ont la responsabilité d'assurer la conformité de la Société à ses obligations ; et
- confirment :
  - qu'une déclaration de politique de conformité a été préparée, afin de présenter les politiques de la Société (qui, de l'avis des Administrateurs, sont appropriées pour la Société) assurant la conformité de la Société à ses obligations ;
  - que, de l'avis des Administrateurs, une structure adéquate a été mise en place pour garantir une excellente conformité aux obligations de la Société ; et
  - qu'une procédure de contrôle annuelle a été mise en place pour examiner les obligations incombant à la Société et vérifier qu'une structure existante permet d'observer ces obligations.

### Résultats et dividendes

Les résultats et les dividendes de l'exercice financier figurent dans l'État du résultat global.

### Événements intervenus au cours de l'exercice financier

Veuillez vous reporter à la Note 17 pour connaître les événements significatifs intervenus au cours de l'exercice financier.

### Événements survenus depuis la clôture de l'exercice financier

Veuillez vous reporter à la Note 18 pour connaître les événements significatifs intervenus depuis la clôture de l'exercice financier.

### Administrateurs

Les noms des Administrateurs en fonction durant l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 sont indiqués ci-dessous.

M. Tom Finlay\* (irlandais) (démissionnaire au 16 mars 2023)  
M. Patrick J. Riley\* (américain) (démissionnaire au 16 mars 2023)  
Mme Barbara Healy\* (irlandaise)  
Mme Kathleen Gallagher (australienne)  
Mme Ellen Needham (américaine) (démissionnaire au 1<sup>er</sup> mai 2023)  
Mme Jennifer Fox\* (irlandaise) (nommée le 16 mars 2023)

\* Administrateurs indépendants. Tous les autres Administrateurs sont des administrateurs non indépendants.

Tous les Administrateurs sont des Administrateurs non exécutifs.

Les commissions des Administrateurs indépendants durant l'exercice financier ont été de 128 510 USD (31 mars 2022 : 142 496 USD), le montant dû aux Administrateurs à la clôture de l'exercice financier était de 11 679 USD (31 mars 2022 : 0 USD).

### Participation des Administrateurs et du Secrétaire

Le Conseil d'administration n'a connaissance d'aucune participation détenue dans la Société par un Administrateur ou par le Secrétaire au cours des exercices financiers clôturés les 31 mars 2023 et 31 mars 2022 ou à la date de leur nomination.

### Commissaire aux comptes indépendant

Ernst & Young a été désigné commissaires aux comptes le 23 septembre 2021. Ernst & Young a manifesté sa volonté de conserver sa fonction conformément à la section 383 (2) du *Companies Act* de 2014 (tel qu'amendé).

### Donations politiques

Aucun don politique n'a été réalisé durant les exercices clôturés les 31 mars 2023 ou 31 mars 2022.

### Comité d'audit

SSGA SPDR ETFs Europe I plc a constitué un Comité d'audit. Tom Finlay, Patrick J. Riley (jusqu'à leur démission, le 16 mars 2023), Barbara Healy et Jennifer Fox (nommée le 16 mars 2023) siègent au Comité d'audit et assurent la supervision des commissaires aux comptes externes et des équipes chargées de la préparation des informations financières et du reporting. Le Comité d'audit se réunit au moins une fois par an en temps opportun du cycle de déclaration et d'audit.

### Opérations entre personnes rattachées

Le Règlement 43(1) de la Réglementation OPCVM « Restrictions des transactions avec des personnes rattachées » indique qu'« Une personne responsable doit garantir que toute transaction intervenant entre un OPCVM et une personne rattachée est réalisée a) conformément au principe de pleine concurrence ; et b) dans le meilleur intérêt des porteurs de parts de l'OPCVM ».

Selon les termes du Règlement OPCVM 81.4, les Administrateurs sont, en tant que personnes responsables, satisfaites des accords en place (documentés par des procédures écrites) qui visent à garantir que les obligations prescrites par le Règlement 43(1) s'appliquent à toutes les transactions avec des personnes rattachées et que toutes les transactions avec des personnes rattachées conclues au cours de l'exercice financier concerné ont satisfait aux obligations prescrites par le Règlement 43(1).

### Pour le compte du Conseil d'administration :

Administratrice Barbara Healy

Administratrice Jennifer Fox

24 juillet 2023

## Rapport du Dépositaire aux Actionnaires

Nous avons, en notre qualité de Gestionnaire de SSGA SPDR ETFs Europe I plc (la « Société »), vérifié la conduite de State Street Global Advisors Europe Limited et de la Société elle-même durant l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023.

Le présent rapport, incluant l'opinion, a été préparé à l'intention exclusive de l'ensemble des Actionnaires de la Société, conformément au Règlement 34, (1), (3) et (4) en Partie 5 de la Réglementation de 2011 des Communautés européennes (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières) dans sa version amendée (la « Réglementation OPCVM »), et à aucune autre fin. L'opinion que nous exprimons ne saurait engager notre responsabilité à quelque autre fin ou envers quelque autre personne à laquelle le présent rapport serait présenté.

### Responsabilités du Dépositaire

Nos obligations et responsabilités sont stipulées dans le Règlement 34, (1), (3) et (4) en Partie 5 de la Réglementation OPCVM. L'une de ces obligations consiste notamment à nous enquêter de la conduite de la société pour chaque exercice comptable annuel et à en rendre compte aux Actionnaires.

Notre rapport doit établir si selon nous, au cours dudit exercice financier, la gestion de la Société a été conforme aux dispositions prévues par l'Acte constitutif (l'« Acte constitutif ») de la Société et par la Réglementation OPCVM. Il relève de la responsabilité générale de la Société de se conformer auxdites dispositions. Si la Société ne s'est pas conformée à ces dispositions, alors nous devons, en notre qualité de Dépositaire, indiquer quelles en sont les raisons et définir les étapes à suivre pour remédier à la situation.

### Fondements de l'opinion du Dépositaire

Le Dépositaire effectue toutes les vérifications qu'il juge raisonnablement nécessaires à l'exercice des obligations définies dans le Règlement 34, (1), (3) et (4) en Partie 5 de la Réglementation OPCVM et s'assure que, dans tous les aspects significatifs, la Société a été gérée (i) conformément aux limites imposées par l'Acte constitutif de la Société et par la Réglementation pour encadrer sa capacité d'investissement et d'emprunt et (ii) autrement, conformément aux documents constitutifs de la Société et aux réglementations appropriées.

### Opinion

À notre avis, la Société, au cours de l'exercice financier, a été gérée à tous égards significatifs :

(i) conformément aux restrictions imposées aux pouvoirs d'investissement et d'emprunt de la Société par l'Acte constitutif, la Réglementation OPCVM et la Réglementation (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières) de 2019 issue de la Réglementation intitulée *Central Bank (Supervision And Enforcement) Act (Section 48(1))* de 2013 (la « Réglementation OPCVM ») ; et

(ii) autrement, conformément aux dispositions de l'Acte constitutif, de la Réglementation OPCVM et de la Réglementation OPCVM de la Banque centrale.

**State Street Custodial Services (Ireland) Limited**  
**78 Sir John Rogerson's Quay**  
**Dublin D02 HD32**  
**Irlande**

**24 juillet 2023**



## Rapport des Gestionnaires d'investissement

### Compartiments obligataires à gestion passive et compartiments actions à gestion passive

#### Performance des Compartiments

##### Compartiments obligataires à gestion passive

Globalement, les Compartiments obligataires de SSGA SPDR ETFs Europe I Plc ont réalisé une performance comparable à celle de leurs indices de référence respectifs sur l'exercice clôturé le 31 mars 2023. Les Compartiments pour lesquels l'écart de performance a été supérieur à celui normalement anticipé, sont détaillés ci-dessous, le cas échéant.

##### Obligations d'État de marchés développés

Les compartiments d'obligations d'État de marchés développés sont, entre autres, exposés aux marchés des bons du Trésor et d'obligations souveraines ou d'organismes parapublics de la zone euro et des États-Unis ainsi qu'au marché des obligations britanniques. Tous les Compartiments ont obtenu des résultats dans une fourchette de +/-3 pb, largement contenus dans leurs limites de tolérance respectives en termes de risque et de performance.

##### Obligations d'entreprise de qualité *investment grade* (IG)

Les Compartiments d'obligations d'entreprise *investment grade* (IG), couvrant des expositions sur les marchés des États-Unis, de l'euro et de la livre sterling, ont tous répliqué fidèlement leurs performances de référence et ont obtenu des résultats dans une fourchette de +/-15 pb.

Les marchés obligataires ont connu des difficultés tout au long de 2022, que ce soit en termes de volatilité ou de liquidité, sur fonds de hausses de taux, d'inflation élevée, de ralentissement de la croissance et de guerre en Ukraine. Ces facteurs ont pesé sur le sentiment des investisseurs, entraînant une importante dispersion des rendements obligataires parmi les différents émetteurs privés et des coûts de négociation élevés.

##### Compartiments obligataires mixtes

Les Compartiments Aggregate sont exposés à de multiples segments obligataires couvrant les bons du Trésor, les obligations souveraines, les obligations d'entreprise et les obligations titrisées. Tous les Compartiments Aggregate ont obtenu des résultats dans une fourchette de +/-10 pb, largement contenus dans leurs limites de tolérance respectives en termes de risque et de performance.

##### Haut rendement

Les Compartiments de qualité inférieure à *investment grade* (ou à haut rendement) investissent dans des obligations d'entreprise assorties d'un risque de crédit élevé. Les tolérances établies en termes de réplification de la performance sont plus souples pour ces compartiments étant donné qu'ils appartiennent à un segment du marché obligataire faisant l'objet d'une volatilité inhérente plus élevée, mais également d'une liquidité inférieure par rapport aux autres. Du fait des coûts de transaction élevés des titres à haut rendement, ces compartiments sont également tenus de construire un échantillonnage plus diversifié dans le cadre de leur processus de gestion afin de réduire la baisse de performance résultant des coûts de transaction en question.

Le Compartiment SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF (Dist) a sous-performé son indice de référence de -46,0 pb au cours de la période de douze mois considérée. La majorité de l'écart de performance (-32 pb) est imputable à la sélection de titres compte tenu de la volatilité élevée déclenchée par l'invasion de l'Ukraine par la Russie et accrue par la suite par la mise en œuvre d'un cycle de relèvement de taux agressif par la Réserve fédérale (Fed), suivi d'un autre mis en route par la Banque centrale européenne (BCE). Le Compartiment a également dû faire face aux sorties de fonds et coûts de rééquilibrage associés, étant donné les conditions de marché difficiles et la vague de liquidation prévalant au cours de la première moitié de la période. Les marchés du haut rendement se sont ensuite repris après le plancher enregistré en septembre 2022 et ont vu les prix augmenter rapidement. Pour la période de douze mois considérée, les coûts globaux supplémentaires de rééquilibrage se sont approximativement élevés à 13 pb.

##### Marchés émergents

Les Compartiments de marchés émergents présentent également des limites de tolérance plus importantes en matière de risque et de suivi en raison d'une volatilité plus élevée et d'une liquidité plus faible inhérentes à ce segment. Les compartiments de titres de créance libellés en devise locale ont également souffert d'une baisse de performance structurelle en raison des charges fiscales appliquées à certains marchés locaux et non reflétées dans les rendements de l'indice de référence. La majorité des Compartiments ont obtenu des résultats dans une fourchette de +/-15 pb, largement contenus dans leurs limites de tolérance respectives en termes de risque et de performance, à l'exception du Compartiment SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF (Acc).

Le Compartiment SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF (Acc) a affiché un écart de performance de -27,0 pb par rapport à son indice de référence, dû au poids des impôts (-19 pb), provenant principalement des titres brésiliens (-14,5 pb) mais aussi indonésiens (-8,4 pb). Les effets d'échantillonnage sur l'ensemble du portefeuille ont compté pour un total de -6,2 pb, un bon résultat compte tenu des conditions de marché, tandis que les coûts de transaction se sont chiffrés à tout juste -4 pb pour l'ensemble de la période de douze mois.

##### Analyse du marché

Le mouvement de vente massive sur le marché obligataire mondial a démarré au début de 2022 et s'est poursuivi sur pratiquement toute la première moitié de la période considérée (d'avril à septembre 2022). Les rendements ont progressé au deuxième trimestre de 2022 en raison de niveaux d'inflation élevée à l'échelle mondiale que les décideurs politiques ont tenté de rattraper en rehaussant les taux d'intérêt. Ce n'est qu'à partir du quatrième trimestre 2022, après de multiples hausses de taux que les marchés obligataires ont commencé à se stabiliser, aidés par un reflux de l'inflation et le plafonnement final des taux. Les banques centrales ont encore montré leur détermination à faire baisser l'inflation, laquelle est restée élevée malgré une légère amélioration enregistrée après le sommet atteint.



## Rapport des Gestionnaires d'investissement (suite)

### Compartiments obligataires à gestion passive et compartiments actions à gestion passive (suite)

#### Marchés émergents (suite)

##### Analyse du marché (suite)

Les rendements obligataires ont connu un redressement au début de 2023, initialement porté par les inquiétudes entourant la croissance, qui s'est emballé par la suite en raison des événements déstabilisants survenus dans le secteur des banques régionales américaines. Malgré les variations sensibles des prix des actifs, la réouverture ferme de l'économie chinoise et le repli des cours des matières premières ont contribué dans une certaine mesure à la stabilisation des prévisions macroéconomiques. Si l'inflation globale a ralenti, le maintien de certaines poches d'inflation sous-jacente a continué de susciter des inquiétudes chez les investisseurs et les décideurs politiques. Le cycle de resserrement monétaire mondial mis en place par les plus grandes banques centrales était déjà bien avancé, quand bien même ces institutions faisaient part de leur intention de maintenir leurs taux à des niveaux élevés et des conditions financières fermes, dans l'objectif de garantir la poursuite du ralentissement de l'inflation. Au cours des six derniers mois de la période considérée, la Fed a relevé les taux directeurs américains de 1,75 % au total, tandis que la BCE a hissé les siens de 2,25 à 3,5 %.

L'effondrement de la Silicon Valley Bank et le rachat forcé de Credit Suisse par son rival national UBS, ont montré combien la confiance des investisseurs était devenue fragile, perturbant ainsi le marché de manière significative. Malgré la situation, les répercussions ont été relativement limitées en Europe, principalement parce que les banques européennes opèrent dans un environnement réglementaire bien plus strict, tant du point de vue de la liquidité que des réserves de capital. Les investisseurs ont renoué avec la confiance et aucun effet domino n'a été observé. En Chine, l'activité manufacturière a rebondi et les services et le marché du logement se sont l'un comme l'autre fortement redressés.

Malgré cet environnement difficile à l'entrée de 2023, les rendements obligataires ont bien résisté, les investisseurs anticipant la fin éventuelle du cycle de resserrement monétaire en cours. Les rendements ont également bénéficié au mois de mars des achats d'obligations d'État, faisant office de valeurs refuges, dès lors que la crise des banques régionales a commencé à s'atténuer aux États-Unis. Le rendement des bons du Trésor américain à 10 ans a clôturé la période à 3,47 %, contre 2,34 % enregistrés en début de période. Parallèlement, en Europe, l'inflation générale est tombée à son plus bas sur un an au mois de mars 2023, alors que l'inflation sous-jacente poursuivait sa progression. Les rendements des obligations d'État européennes ont également commencé à se replier par rapport à leurs points hauts de début mars 2023. Les obligations d'État du Royaume-Uni ont enregistré une reprise de moindre durée avec des rendements à 10 ans s'établissant à 3,49 %.

Sur les marchés émergents, les rendements sur la période de douze mois se terminant en mars 2023 ont fini dans le rouge tant pour la dette en devise locale qu'en devise forte. Au cours de la période considérée, la dette des marchés émergents (ME) en devise locale a affiché un rendement de -0,72 % (en termes d'USD), mesuré par l'indice JP Morgan GBI-EM Global Diversified Index. La dette souveraine des ME en devise forte a enregistré un rendement de -6,92 % (en termes d'USD), selon l'indice JP Morgan EMBI Global Diversified Index. L'inflation dans les ME a également montré des signes d'inflexion et les rendements ont entrepris un repli, le marché intégrant dans ses prix la possibilité d'un assouplissement monétaire pour la fin de l'année 2023.

#### Compartiments actions à gestion passive

Aucun nouvel ETF n'a été lancé pendant la période considérée.

La majorité des Compartiments Actions se sont tenus dans les marges d'écart prévues pour leurs indices respectifs sur une année complète ou depuis leur date de création.

Tous les Compartiments se sont inscrits dans la fourchette d'écart de suivi *ex post* annuel prévisionnel à un an. Il est cependant à souligner que lorsqu'elle est d'un an, la période de l'écart de suivi *ex post* est trop courte pour appréhender si le compartiment se situe dans une marge de tolérance acceptable. Un horizon de trois ans serait plus conforme aux normes du secteur d'activité.

Des informations complémentaires sont fournies lorsque l'écart de performance d'un compartiment s'établit à +/-0,10 % sur une base brute de commissions ou si l'écart de suivi sur 1 an est perçu comme étant élevé. Pendant la période annuelle considérée :

- La surperformance du Compartiment SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF (0,51 %) est principalement attribuable aux retenues fiscales à la source.
- La surperformance du Compartiment SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF (0,41 %) est principalement attribuable aux retenues fiscales à la source.
- La surperformance du Compartiment SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF (0,44 %) est principalement attribuable aux retenues fiscales à la source.
- La surperformance du Compartiment SPDR MSCI ACWI UCITS ETF (0,36 %) est principalement attribuable aux retenues fiscales à la source et à des pondérations de titre inadéquates.
- La surperformance du Compartiment SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF (0,18 %) est principalement attribuable aux avantages de la retenue fiscale à la source.
- La surperformance du Compartiment SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF (0,38 %) est principalement attribuable aux retenues fiscales à la source.

## Rapport des Gestionnaires d'investissement (*suite*)

### Compartiments obligataires à gestion passive et compartiments actions à gestion passive (*suite*)

#### Compartiments Actions à gestion passive (*suite*)

- La surperformance du Compartiment SPDR S&P 500 UCITS ETF (0,25 %) est principalement attribuable aux retenues fiscales à la source.
- La sous-performance du Compartiment SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF (-0,68 %) est principalement imputable aux coûts de transaction.
- La surperformance du Compartiment SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF (0,72 %) est principalement attribuable aux retenues fiscales à la source.
- La surperformance du Compartiment SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF (0,37 %) est principalement attribuable aux retenues fiscales à la source.
- La surperformance du Compartiment SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF (0,11 %) est principalement attribuable aux retenues fiscales à la source.
- La sous-performance du Compartiment SPDR S&P UK Dividend Aristocrats UCITS ETF (-0,26 %) est principalement attribuable aux coûts de transaction.
- La surperformance du Compartiment SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF (0,43 %) est principalement attribuable aux retenues fiscales à la source.
- La surperformance du Compartiment SPDR MSCI EMU UCITS ETF (0,60 %) est principalement attribuable aux retenues fiscales à la source.
- La surperformance du Compartiment SPDR MSCI World UCITS ETF (0,33 %) est principalement attribuable aux pondérations de titre inadéquates et aux retenues fiscales à la source.
- La surperformance du Compartiment SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF (0,25 %) est principalement attribuable aux retenues fiscales à la source.

## Rapports des Gestionnaires d'investissement (*suite*) Compartiments obligataires à gestion passive :

Performance, brute de commissions au 31 mars 2023

| Nom du Compartiment   | Compar-<br>timent | Indice<br>sur 1 an | Diff. | Compar-<br>timent | Depuis la création de<br>l'Indice* | Diff. | Date de création du<br>Compartiment | Écart de suivi annuel<br>anticipé, max % | Écart de suivi ex<br>post % (1 an)** |
|---|-------------------|--------------------|-------|-------------------|------------------------------------|-------|-------------------------------------|--|--------------------------------------|
| <b>BONS DU TRÉSOR/OBLIGATIONS D'ÉTAT DES MARCHÉS DÉVELOPPÉS</b> |                   |                    |       |                   |                                    |       |                                     |  |                                      |
| SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF                       | 2,59              | 2,60               | -0,01 | 1,08              | 1,10                               | -0,02 | 18 juil. 2019                       | 1  | 0,06                                 |
| SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF          | -3,10             | -3,09              | -0,01 | 0,46              | 0,46                               | 0,00  | 14 nov. 2011                        | 1  | 0,01                                 |
| SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF            | 0,24              | 0,23               | 0,01  | 0,84              | 0,84                               | 0,00  | 27 août 2013                        | 1  | 0,02                                 |
| SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF                   | -11,78            | -11,78             | 0,00  | 2,10              | 2,05                               | 0,05  | 23 mai 2011                         | 1  | 0,02                                 |
| SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF                              | -6,52             | -6,49              | -0,03 | 2,83              | 2,84                               | -0,01 | 02 déc. 2015                        | 1  | 0,21                                 |
| SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF                     | -4,51             | -4,51              | 0,00  | 1,50              | 1,48                               | 0,02  | 3 juin 2011                         | 1  | 0,02                                 |
| <b>OBLIGATIONS D'ENTREPRISE DE QUALITÉ INVESTMENT GRADE</b>     |                   |                    |       |                   |                                    |       |                                     |  |                                      |
| SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF           | -1,84             | -1,72              | -0,12 | 0,25              | 0,34                               | -0,09 | 27 août 2013                        | 1  | 0,08                                 |
| SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF           | 1,00              | 0,98               | 0,02  | 1,56              | 1,59                               | -0,03 | 27 août 2013                        | 1  | 0,08                                 |
| SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF          | -1,94             | -1,99              | 0,05  | 2,61              | 2,57                               | 0,04  | 17 févr. 2016                       | 1  | 0,09                                 |
| SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF                | -7,64             | -7,50              | -0,14 | -5,16             | -5,05                              | -0,11 | 16 oct. 2020                        | 1  | 0,08                                 |
| SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF                | -5,81             | -5,72              | -0,09 | -4,90             | -4,79                              | -0,11 | 23 oct. 2020                        | 1  | 0,07                                 |

## Rapports des Gestionnaires d'investissement (suite) Compartiments obligataires à gestion passive : (suite)

Performance, brute de commissions au 31 mars 2023 (suite)

| Nom du Compartiment  | Compar-<br>timent | Indice<br>sur 1 an | Diff. | Compar-<br>timent | Depuis la création de<br>l'Indice* | Diff. | Date de création du<br>Compartiment | Écart de suivi annuel<br>anticipé, max % | Écart de suivi ex<br>post % (1 an)** |
|--|-------------------|--------------------|-------|-------------------|------------------------------------|-------|-------------------------------------|--|--------------------------------------|
| <b>COMPARTIMENTS OBLIGATAIRES MIXTES</b>                       |                   |                    |       |                   |                                    |       |                                     |  |                                      |
| SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF                   | -10,65            | -10,61             | -0,04 | 1,87              | 1,81                               | 0,06  | 23 mai 2011                         | 1  | 0,03                                 |
| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF                 | -8,16             | -8,07              | -0,09 | -1,36             | -1,30                              | -0,06 | 26 janv. 2018                       | 1  | 0,06                                 |
| <b>OBLIGATIONS À HAUT RENDEMENT</b>                            |                   |                    |       |                   |                                    |       |                                     |  |                                      |
| SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF                  | -4,12             | -3,66              | -0,46 | 4,20              | 4,21                               | -0,01 | 03 févr. 2012                       | 2  | 0,16                                 |
| SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS<br>ETF | -3,32             | -3,21              | -0,11 | 3,20              | 3,29                               | -0,09 | 19 sept. 2013                       | 2  | 0,32                                 |
| <b>OBLIGATIONS DE MARCHÉS ÉMERGENTS</b>                        |                   |                    |       |                   |                                    |       |                                     |  |                                      |
| SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF                   | -4,62             | -4,68              | 0,06  | -1,70             | -1,75                              | 0,05  | 10 nov. 2021                        | 1  | S/O                                  |
| SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF           | -1,64             | -1,37              | -0,27 | 0,15              | 0,45                               | -0,30 | 16 mai 2011                         | 2  | 0,09                                 |

\* Performance annualisée sur des périodes d'un an.

\*\* Calculé au moyen de la moyenne quadratique des rendements excédentaires mensuels (c'est-à-dire la « Différence ») sur l'exercice clôturé en mars 2023.

Les actifs nets sous gestion de chaque Compartiment au 31 mars 2023 sont détaillés dans la section « Informations de base sur la Société ». La Valeur liquidative par action publiée est indiquée dans l'État de la situation financière de chaque Compartiment.

Le TFE annuel de chaque Compartiment est indiqué en Note 3.

## Rapports des Gestionnaires d'investissement (suite) Compartiments actions à gestion passive :

Performance, brute de commissions au 31 mars 2023

| Nom du Compartiment                                      | Compar-<br>timent | Indice<br>sur 1 an | Compar-<br>timent | Diff. | Depuis la création de<br>l'Indice* | Diff. | Date de création du<br>Compartiment | Écart de suivi annuel<br>anticipé, max % | Écart de suivi ex<br>post % (1 an)** |
|--|-------------------|--------------------|-------------------|-------|------------------------------------|-------|-------------------------------------|--|--------------------------------------|
| SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF              | -21,44            | -21,53             | 0,09              | 3,50  | 3,39                               | 0,11  | 24 oct. 2012                        | 1  | 0,10                                 |
| SPDR FTSE EPRA Europe ex UK Real Estate UCITS ETF        | -37,33            | -37,34             | 0,01              | -1,22 | -1,07                              | -0,15 | 7 août 2015                         | 1  | 0,20                                 |
| SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF                       | 2,90              | 2,92               | -0,02             | 6,62  | 6,54                               | 0,08  | 28 févr. 2012                       | 1  | 0,06                                 |
| SPDR MSCI ACWI UCITS ETF                                 | -7,08             | -7,44              | 0,36              | 7,91  | 7,57                               | 0,34  | 16 mai 2011                         | 1  | 0,11                                 |
| SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF                              | -9,45             | -9,44              | -0,01             | 3,28  | 3,26                               | 0,02  | 16 mai 2011                         | 1  | 0,17                                 |
| SPDR MSCI EMU UCITS ETF                                  | 8,74              | 8,14               | 0,60              | 7,92  | 7,38                               | 0,54  | 25 janv. 2013                       | 1  | 0,26                                 |
| SPDR MSCI Japan UCITS ETF                                | 3,90              | 3,92               | -0,02             | 5,41  | 5,46                               | -0,05 | 30 nov. 2015                        | 1  | 0,09                                 |
| SPDR MSCI World UCITS ETF                                | -6,69             | -7,02              | 0,33              | 9,46  | 9,18                               | 0,28  | 28 févr. 2019                       | 1  | 0,11                                 |
| SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF                      | -5,43             | -5,61              | 0,18              | 10,64 | 10,43                              | 0,21  | 30 janv. 2012                       | 1  | 0,06                                 |
| SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF***                    | -6,12             | -6,37              | 0,25              | 11,33 | 11,08                              | 0,25  | 02 déc. 2019                        | 1  | 0,02                                 |
| SPDR S&P 500 UCITS ETF                                   | -7,95             | -8,20              | 0,25              | 12,02 | 11,70                              | 0,32  | 19 mars 2012                        | 1  | 0,05                                 |
| SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF                    | -4,98             | -5,36              | 0,38              | 10,09 | 9,72                               | 0,37  | 03 oct. 2012                        | 1  | 0,03                                 |
| SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF | -3,60             | -2,92              | -0,68             | -0,27 | 0,17                               | -0,44 | 14 oct. 2011                        | 1  | 0,23                                 |
| SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF             | 4,76              | 4,04               | 0,72              | 7,12  | 6,45                               | 0,67  | 28 févr. 2012                       | 1  | 0,30                                 |

## Rapports des Gestionnaires d'investissement (suite) Compartiments actions à gestion passive : (suite)

Performance, brute de commissions au 31 mars 2023 (suite)

| Nom du Compartiment                              | Compartiment | Indice sur 1 an | Compartiment | Diff. | Depuis la création de l'Indice* | Diff. | Date de création du Compartiment | Écart de suivi annuel anticipé, max % | Écart de suivi ex post % (1 an)** |
|--|--------------|-----------------|--------------|-------|---------------------------------|-------|----------------------------------|---------------------------------------|-----------------------------------|
| SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF   | -9,64        | -10,01          | 0,37         | 4,34  | 3,97                            | 0,37  | 15 mai 2013                      | 1                                     | 0,10                              |
| SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF | -10,69       | -10,80          | 0,11         | 3,33  | 3,32                            | 0,01  | 15 mai 2013                      | 1                                     | 0,15                              |
| SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF     | -5,65        | -5,39           | -0,26        | 4,23  | 4,41                            | -0,18 | 28 févr. 2012                    | 1                                     | 0,25                              |
| SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF     | -0,97        | -1,40           | 0,43         | 11,80 | 11,34                           | 0,46  | 14 oct. 2011                     | 1                                     | 0,09                              |

\* Performance annualisée sur des périodes d'un an.

\*\* Calculé au moyen de la moyenne quadratique des rendements excédentaires mensuels (c'est-à-dire la « Différence ») sur l'exercice clôturé en mars 2023.

\*\*\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

Les actifs nets sous gestion de chaque Compartiment au 31 mars 2023 sont détaillés dans la section « Informations de base sur la Société ». La Valeur liquidative par action publiée est indiquée dans l'État de la situation financière de chaque Compartiment.

Le TFE annuel de chaque Compartiment est indiqué en Note 3.

## RAPPORT DES COMMISSAIRES AUX COMPTES AUX MEMBRES DE SSGA SPDR ETFs EUROPE I PLC

### *Rapport sur l'audit des États financiers*

#### **Opinion**

Nous avons audité les états financiers de SSGA SPDR ETFs Europe I plc (la « Société ») pour l'exercice clôturé le 31 mars 2023, composés de l'État de la situation financière, l'État du résultat global, l'État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables, l'État des flux de trésorerie de la Société ainsi que les notes annexes y afférentes, y compris un résumé des principales conventions comptables définies dans la Note 1. Le cadre d'information financière appliqué à leur préparation est constitué de la législation irlandaise et des normes internationales d'information financière (« IFRS ») adoptées par l'Union européenne.

Notre opinion est que les états financiers :

- donnent une image sincère et fidèle de l'actif, du passif et de la situation financière de la Société au 31 mars 2023 ainsi que de ses moins-values pour l'exercice clôturé à cette date ;
- ont été préparés conformément aux IFRS adoptées par l'Union européenne ; et
- ont été préparés selon les exigences du *Companies Act* de 2014, du Règlement des Communautés européennes (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières) de 2011 et de la Réglementation de 2019 instituée en vertu de la loi irlandaise sur la surveillance et le contrôle d'application de la Banque centrale de 2013 (Section 48(1)).

#### **Fondement de notre avis**

Nous avons procédé à notre audit conformément aux Normes d'audit internationales d'Irlande, également désignées sous le terme « IAS (Irlande) » et en vertu du droit applicable. Les responsabilités qui nous incombent en vertu de ces normes sont décrites plus amplement sous le titre « Responsabilités des Commissaires aux comptes à l'égard de l'audit des états financiers » ci-après. Nous sommes indépendants de la Société conformément aux prescriptions déontologiques applicables à notre audit des états financiers en Irlande, comprenant la Norme éthique de l'IAASA (*Irish Auditing and Accounting Supervisory Authority*) telle qu'appliquée aux entités d'intérêt public, et avons satisfait à nos autres responsabilités en matière d'éthique conformément à ces exigences.

Nous estimons que nous avons réuni suffisamment d'éléments probants pertinents pour fonder notre opinion.

#### **Conclusions relatives à la continuité d'exploitation**

Lors de l'audit des états financiers, nous avons conclu que le principe de la continuité d'exploitation utilisé par les administrateurs lors de la préparation des états financiers était approprié. Notre évaluation de l'appréciation par les administrateurs de la capacité de la Société à continuer d'adopter le principe de la continuité d'exploitation a inclus :

- la confirmation de notre compréhension du processus d'évaluation de la continuité d'exploitation par la direction et nous nous sommes également entretenus avec la direction pour comprendre les facteurs clés qui ont été pris en compte dans leur évaluation ;
- l'obtention de l'évaluation de la continuité de l'exploitation par la direction, qui couvre une année à partir de la date d'approbation des états financiers ;



Building a better  
working world

## **RAPPORT DES COMMISSAIRES AUX COMPTES AUX MEMBRES DE SSGA SPDR ETFS EUROPE I PLC (SUITE)**

- l'examen et l'évaluation du caractère raisonnable des facteurs clés pris en compte par la direction dans son évaluation du principe de la continuité d'exploitation, y compris la disponibilité de liquidités pour faire face aux coûts opérationnels courants et aux activités d'investissement futures connues de la Société. Ce faisant, nous avons obtenu et examiné les conditions de liquidité que la Société offre aux investisseurs, ainsi que l'activité de capital après la fin de l'année, et nous avons corroboré, en interrogeant la direction, l'existence d'événements postérieurs à l'arrêté des comptes, y compris la performance de la Société, qui pourraient donner lieu à des conditions susceptibles d'amener la direction à mettre fin aux activités de la Société.
- l'examen des informations relatives au principe de continuité d'exploitation incluses dans le rapport annuel par la Société afin d'évaluer si ces informations sont appropriées et conformes aux normes applicables en matière d'information financière.

### **Conclusion**

Au cours du travail que nous avons effectué, nous n'avons pas identifié d'incertitudes significatives liées à des événements ou à des conditions qui, individuellement ou collectivement, pourraient jeter un doute important sur la capacité de la Société à poursuivre leur activité pendant une période d'au moins douze mois à compter de la date à laquelle la publication des états financiers est autorisée.

Nos responsabilités et les responsabilités des Administrateurs relatives au principe de continuité d'exploitation sont stipulées dans les sections correspondantes du présent rapport. Cependant, dans la mesure où il est impossible de prévoir toutes les circonstances ou tous les événements futurs, cette déclaration ne saurait garantir la capacité de la Société à poursuivre ses activités.





Building a better  
working world

## RAPPORT DES COMMISSAIRES AUX COMPTES AUX MEMBRES DE SSGA SPDR ETFS EUROPE I PLC (SUITE)

### Points clés de l'audit

Les points clés de l'audit sont les sujets qui, de notre avis de professionnel, étaient les plus importants dans le cadre de notre audit des états financiers de la période en cours et incluent les risques les plus significatifs d'inexactitude importante évalués (qu'elle soit de nature intentionnelle ou non) que nous avons identifiés, en ce compris ceux qui ont eu l'incidence la plus significative sur la stratégie d'audit globale, l'affectation des ressources dans le cadre de l'audit et l'orientation des efforts de notre équipe chargée de la mission d'audit. Ces questions ont été adressées dans le contexte de notre audit des états financiers pris dans leur ensemble, et en établissant notre opinion y relativement, et nous n'émettons pas d'opinion séparée sur ces questions.

| Risque  | Notre réponse au risque  | Principales observations communiquées au Comité d'audit   |
|---|--|---|
| <p><b>Existence d'actifs financiers et de passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b></p> <p>Nous avons considéré l'existence d'actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat (avec une juste valeur de 45 850 050 484 USD (2022 : 45 021 052 419 USD)) et de passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat (avec une juste valeur de (19 958 338 USD) (2022 : (26 939 568 USD))) comme une question clé de l'audit, car il s'agit d'un élément clé de la performance et de la valeur liquidative de la Société.</p> <p>Veillez vous référer à la Note 1 et à la Note 11 aux états financiers.</p> | <p>Nous avons évalué le caractère raisonnable de l'existence de tous les actifs financiers et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat en procédant à ce qui suit :</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>▶ l'obtention du rapport sur les contrôles de l'organisation des services (Service Organisation Controls, « SOC1 ») pour State Street Fund Services (Ireland) Limited, y compris le rapport de leurs comptables indépendants à ce sujet en nous forgeant une compréhension et en évaluant la conception, la mise en œuvre et l'efficacité opérationnelle des contrôles sur le processus de rapprochement des actifs financiers et des passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat.</li> <li>▶ la vérification que les éléments de rapprochement significatifs étaient des éléments de rapprochement valides, en obtenant les pièces justificatives et en nous assurant que leur résolution s'est faite dans un délai approprié.</li> <li>▶ l'approbation des actifs financiers et des passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat détenus dans le réseau du dépositaire en vertu d'une confirmation du dépositaire obtenue de manière indépendante.</li> <li>▶ l'approbation des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat détenus en dehors du réseau de dépositaires en vertu de confirmations de contreparties indépendantes ou de relevés bancaires de fin d'année.</li> </ul> | <p>Aucun problème n'a été relevé lors de l'exécution de nos procédures sur ce point clé de l'audit.</p> |



Building a better  
working world

## RAPPORT DES COMMISSAIRES AUX COMPTES AUX MEMBRES DE SSGA SPDR ETFS EUROPE I PLC (SUITE)

### Points clés de l'audit (suite)

| Risque   | Notre réponse au risque  | Principales observations communiquées au Comité d'audit   |
|--|--|---|
| <p><b>Valorisation d'actifs financiers et de passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b></p> <p>Nous avons considéré l'existence d'actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat (avec une juste valeur de 45 850 050 484 USD (2022 : 45 021 052 419 USD)) et de passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat (avec une juste valeur de (19 958 338 USD) (2022 : (26 939 568 USD))) comme une question clé de l'audit, car il s'agit d'un élément clé de la performance et de la valeur liquidative de la Société.</p> <p>Veillez vous référer à la Note 1 et à la Note 11 aux états financiers.</p> | <p>Nous avons évalué le caractère raisonnable de la valorisation de tous les actifs financiers et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat en procédant à ce qui suit :</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>▶ l'obtention du rapport SOC1 pour State Street Fund Services (Ireland) Limited, y compris le rapport de leurs comptables indépendants à ce sujet, et en nous forgeant une compréhension et en évaluant la conception, la mise en œuvre et l'efficacité opérationnelle des contrôles sur le processus de valorisation des actifs financiers et des passifs financiers à la juste valeur par le biais du résultat.</li> <li>▶ le test de la valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat en faisant appel à des fournisseurs indépendants sur le marché et en comparant les prix par rapport au portefeuille d'investissement ou en recalculant la juste valeur à l'aide de modèles standard du secteur, en évaluant le caractère raisonnable des hypothèses et des données utilisées par les Administrateurs pour évaluer ces actifs financiers et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat.</li> </ul> | <p>Aucun problème n'a été relevé lors de l'exécution de nos procédures sur ce point clé de l'audit.</p> |

## **RAPPORT DES COMMISSAIRES AUX COMPTES AUX MEMBRES DE SSGA SPDR ETFS EUROPE I PLC (SUITE)**

### **Application de l'importance relative**

Nous appliquons le concept d'importance relative dans la planification et la réalisation de l'audit, dans l'évaluation de l'effet des anomalies identifiées sur l'audit et dans la formation de notre opinion d'audit.

#### **Caractère d'importance**

L'ampleur d'une omission ou d'une anomalie dont on pourrait raisonnablement s'attendre à ce qu'elle(s) influence(nt), individuellement ou dans leur ensemble, les décisions économiques des utilisateurs des états financiers. L'importance relative fournit une base pour déterminer la nature et l'étendue de nos procédures d'audit.

Nous avons déterminé que l'importance relative pour la Société était de 0,5 % (2022 : 0,5 %) de la Valeur liquidative de chacun des Compartiments de la Société. Nous pensons que la Valeur liquidative nous fournit une base de mesure appropriée puisqu'il se peut que les utilisateurs des états financiers puissent concentrer davantage leur attention sur celle-ci que sur les bénéfices.

Au cours de notre audit, nous avons réévalué l'importance relative initiale et n'y avons apporté aucun changement.

#### **Importance relative en matière de performance**

Application du caractère d'importance relative au niveau du compte individuel ou du bilan. Il est fixé à un montant permettant de réduire à un niveau suffisamment faible la probabilité que le total des inexactitudes non corrigées et non détectées dépasse l'importance relative.

Sur la base de nos évaluations des risques, ainsi que de notre évaluation de l'environnement de contrôle global de la société, nous avons estimé que l'importance relative vis-à-vis de la performance représentait 75 % (2022 : 50 %) de l'importance relative planifiée. Nous avons fixé l'importance relative de la performance à ce pourcentage d'après notre évaluation du risque d'anomalies, corrigées ou non corrigées. Étant donné que nous avons achevé l'audit des états financiers du premier exercice et compte tenu de notre connaissance des opérations de la société et de l'environnement de contrôle pendant l'exercice en cours, nous avons réexaminé le pourcentage d'importance relative de la performance. Nous avons fixé l'importance relative de la performance à ce pourcentage en raison de notre connaissance du secteur de la Société.

#### **Seuil de signalement**

Un montant en dessous duquel les anomalies identifiées sont considérées comme manifestement insignifiantes.

Nous avons convenu avec le Conseil d'administration que nous lui rapporterions tout écart supérieur à 5 % de l'importance relative ou tout écart inférieur qui, à notre avis, justifie une déclaration pour des raisons qualitatives.

Nous évaluons toute anomalie non corrigée à la fois par rapport aux mesures quantitatives de l'importance relative mentionnées ci-dessus et à la lumière d'autres considérations qualitatives pertinentes pour fonder notre opinion.

#### **Aperçu du périmètre de notre audit**

##### **Personnalisation du périmètre**

Notre évaluation du risque d'audit, notre évaluation de l'importance relative et notre attribution de l'importance relative vis-à-vis de la performance déterminent l'étendue de notre audit pour la Société. Ceci nous permet de nous forger une opinion sur les états financiers. Nous tenons compte de la taille, du profil de risque, de l'organisation de la Société ainsi que de l'efficacité des contrôles, y compris des contrôles et des changements dans l'environnement commercial lorsque nous évaluons le niveau de travail à effectuer. Tous les travaux d'audit ont été réalisés directement par l'équipe de mission d'audit.



Building a better  
working world

## **RAPPORT DES COMMISSAIRES AUX COMPTES AUX MEMBRES DE SSGA SPDR ETFS EUROPE I PLC (SUITE)**

### ***Autres informations***

Les Administrateurs sont responsables des autres informations. Ces autres informations comprennent celles présentées dans le rapport annuel, mais excluent les états financiers proprement dits et notre rapport d'audit. Notre opinion au sujet des états financiers ne porte pas sur ces autres informations. Nous nous abstenons donc de fournir une quelconque garantie à ce propos, sauf indication contraire explicite dans notre rapport d'audit.

Notre responsabilité consiste à lire les autres informations et, ce faisant, à évaluer si elles présentent des incohérences significatives avec celles des états financiers ou avec celles que nous avons obtenues dans le cadre de l'audit, ou bien si elles semblent comporter des anomalies majeures à tous autres égards. Si nous repérons une incohérence ou une inexactitude flagrante, nous devons déterminer si l'anomalie en question provient des états financiers ou des autres informations. Si, en fonction du travail que nous avons effectué, nous concluons que ces autres informations présentent des erreurs significatives, nous sommes tenus de le signaler.

Nous n'avons rien à signaler à cet égard.

### ***Opinion relative à d'autres dispositions du Companies Act de 2014***

À notre avis, exclusivement sur la base des travaux effectués pendant l'audit, nous déclarons que :

- les informations fournies dans le rapport des administrateurs eu égard à l'exercice clôturé et pour lequel les états financiers ont été préparés sont cohérentes avec les états financiers ; et
- le rapport des administrateurs a été élaboré conformément aux prescriptions légales en vigueur.

Nous avons obtenu l'ensemble des informations et explications jugées, à notre connaissance, nécessaires à la réalisation de notre audit.

Nous estimons que les registres comptables de la Société ont rempli les critères pour permettre un audit rapide et correct des états financiers, qui concordent avec les livres comptables.

### ***Éléments que nous sommes tenus de publier par exception***

Sur la base des informations et de la compréhension de la Société et de son environnement, acquises dans le cadre de l'audit, nous n'avons identifié aucune anomalie significative dans le rapport des administrateurs.

En vertu du *Companies Act* de 2014, nous sommes tenus de vous signaler si, à notre avis, les informations requises au titre des Sections 305 à 312 de ladite Loi, qui ont trait aux informations à communiquer relatives à la rémunération et aux transactions, n'ont pas été communiquées par la Société. Nous n'avons rien à signaler à cet égard.

## RAPPORT DES COMMISSAIRES AUX COMPTES AUX MEMBRES DE SSGA SPDR ETFS EUROPE I PLC (SUITE)

### ***Responsabilités respectives***

#### ***Responsabilités des administrateurs à l'égard des états financiers***

Comme expliqué plus en détail dans la Déclaration des responsabilités des Administrateurs à la page 14, les Administrateurs sont tenus de préparer des états financiers, conformément au cadre de l'information financière applicable, qui donnent une image sincère et fidèle. Ils sont également tenus de mettre en place les contrôles internes qu'ils jugent nécessaires pour permettre l'élaboration d'états financiers dépourvus d'anomalies significatives résultant d'une fraude ou d'une erreur.

Lors de la préparation des états financiers, les Administrateurs sont tenus d'évaluer la capacité de la Société à poursuivre ses activités selon le principe de la continuité d'exploitation, à publier, le cas échéant, les informations y relatives et à respecter le principe de la continuité d'exploitation, sauf s'ils ont l'intention de liquider la Société ou d'arrêter ses activités, ou n'ont pas d'autre choix possible que d'y procéder.

#### ***Responsabilités des Commissaires aux comptes à l'égard de l'audit des états financiers***

Nos objectifs consistent à obtenir l'assurance raisonnable que les états financiers sont, dans leur ensemble, exempts d'anomalies significatives résultant d'erreurs ou d'actes frauduleux, et à émettre un rapport de commissariat aux comptes qui contienne notre opinion. L'assurance raisonnable correspond à un haut niveau d'assurance, mais ne garantit aucunement qu'un audit effectué conformément aux IAS (Irlande) détectera dans tous les cas une anomalie significative, s'il en est. Les inexactitudes peuvent être de nature intentionnelle ou non et sont considérées comme importantes si, individuellement ou prise dans leur ensemble, l'on peut raisonnablement s'attendre à ce qu'elles influencent les décisions économiques des utilisateurs prises sur la base des présents états financiers.

#### ***Une explication décrivant dans quelle mesure la mission d'audit a permis de détecter des irrégularités, y compris de nature intentionnelle***

Les irrégularités, y compris de nature intentionnelle, sont des exemples de non-respect des lois et réglementations. Nous concevons des procédures en accord avec nos responsabilités, telles que soulignées ci-dessus, afin de détecter des irrégularités, y compris de nature intentionnelle, qui pourraient être raisonnablement susceptibles d'avoir une incidence significative sur les états financiers. Le risque de ne pas découvrir d'anomalies importantes de nature intentionnelle est plus grand que celui de ne pas détecter d'anomalies importantes résultant d'une erreur, car dans le premier cas, cela implique une dissimulation intentionnelle, sous forme, par exemple, de falsifications ou de fausses déclarations intentionnelles, ou une collusion. En outre, plus grand sera le nombre de non-conformités éliminées des transactions reflétées dans les états financiers et moindre sera la probabilité d'identifier ces non-conformités par le biais de nos procédures. La mesure dans laquelle nos procédures nous permettent de détecter des irrégularités, y compris de nature intentionnelle, est détaillée ci-dessous. Cependant, la responsabilité première de la prévention et de la détection de la fraude incombe à la fois aux personnes chargées de la gouvernance de la Société et à la direction.

Notre approche a été la suivante :

Nous avons obtenu une compréhension des cadres juridiques et réglementaires applicables à la Société et avons déterminé que les plus importants sont le *Companies Act* de 2014, du Règlement des Communautés européennes (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières) de 2011 et de la Réglementation de 2019 institué en vertu de la loi irlandaise sur la surveillance et le contrôle d'application de la Banque centrale de 2013 (Section 48(1)).

Nous avons compris comment la Société se conforme à ces cadres en mettant à jour notre compréhension du système adéquat de contrôle interne en place. Nous avons également pris en compte l'existence de prestataires de services indépendants des fournisseurs, de la séparation adéquate des tâches et de l'environnement réglementé dans lequel la Société opère, qui peuvent réduire les possibilités de fraude.

Nous avons évalué la susceptibilité des états financiers de la Société à d'inexactitudes importantes, y compris la manière dont la fraude pourrait se produire par le biais d'un contournement des contrôles par la direction.



Building a better  
working world

## **RAPPORT DES COMMISSAIRES AUX COMPTES AUX MEMBRES DE SSGA SPDR ETFS EUROPE I PLC (SUITE)**

Sur la base de cette compréhension, nous avons conçu nos procédures d'audit pour identifier les cas de non-conformité avec ces lois et règlements. Nos procédures ont consisté à interroger les personnes chargées de la gouvernance sur d'éventuels cas de non-conformité aux lois et règlements, à examiner les procès-verbaux des réunions du Conseil d'administration au cours de l'année et à obtenir la représentation de la direction.

Une description complémentaire de nos responsabilités relatives à l'audit des états financiers figure sur le site Internet de l'IAASA à l'adresse : [http://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8fa98202dc9c3a/Description\\_of\\_auditors\\_responsibilities\\_for\\_audit.pdf](http://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8fa98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf).

Cette description fait partie intégrante de notre Rapport de Commissaires aux comptes.

### ***Autres sujets sur lesquels nous sommes tenus de faire un rapport***

Nous avons été désignés par les Administrateurs en date du 23 septembre 2021 pour réaliser l'audit des états financiers pour l'exercice clôturé le 31 mars 2022 ainsi que les périodes financières postérieures. La durée totale et ininterrompue de notre mandat incluant les précédents mandats et les renouvellements de notre cabinet est de deux ans.

Nous n'avons pas fourni de services non liés à l'audit proscrits en vertu de la Norme déontologique de l'IAASA et sommes restés indépendants de la Société dans le cadre de notre mandat.

Notre opinion d'audit est conforme à notre rapport additionnel au Conseil d'administration.

### ***Objet de l'audit et personnes vis-à-vis desquelles nous sommes responsables en tant que Commissaires aux comptes***

Notre rapport s'adresse exclusivement aux membres de la Société, en tant qu'organe, conformément à la Section 391 du *Companies Act* de 2014. Nous avons mené nos travaux d'audit à la seule fin de communiquer aux membres de la Société les aspects que nous sommes tenus de leur communiquer dans le Rapport des commissaires aux comptes. Dans les limites maximales autorisées par la loi, nous déclinons toute responsabilité envers toute personne autre que la Société ou ses membres en tant qu'organe, en ce qui concerne nos travaux d'audit et le présent rapport,

Lisa Kealy  
**au nom et pour le compte de  
Ernst & Young Chartered Accountants and Statutory Audit Firm**

**Siège :** Dublin

**Date :** 25 juillet 2023

## État de la situation financière de la Société au 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD           | 2022<br>USD           |
|--|-------|-----------------------|-----------------------|
| <b>Actifs circulants</b>   |       |                       |                       |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                             |       |                       |                       |
|  | 1(e)  |                       |                       |
| Valeurs mobilières   |       | 45 747 516 775        | 44 971 069 423        |
| Instruments financiers dérivés   |       | 102 533 709           | 49 982 996            |
|  |       | <b>45 850 050 484</b> | <b>45 021 052 419</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie  | 1(f)  | 299 602 100           | 247 411 849           |
| Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties à des instruments financiers ouverts     | 1(g)  | 3 918 661             | 6 802 680             |
| Créances :   |       |                       |                       |
| Dividendes à recevoir  |       | 58 878 172            | 59 662 593            |
| Intérêts à recevoir  |       | 198 543 310           | 180 717 299           |
| Produits divers à recevoir   |       | 1 095                 | 1 454                 |
| À recevoir sur cessions d'investissements  |       | 530 489 265           | 481 078 044           |
| À recevoir sur cessions d'actions de fonds   |       | 81 934 322            | 121 576 787           |
|  |       | <b>47 023 417 409</b> | <b>46 118 303 125</b> |
| <b>Total des actifs circulants</b>   |       |                       |                       |
| <b>Passifs circulants</b>  |       |                       |                       |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                            |       |                       |                       |
| Instruments financiers dérivés   | 1(e)  | (19 958 338)          | (26 939 568)          |
| Découverts bancaires   | 1(f)  | (3 533 637)           | (1 643)               |
| Liquidités dues aux courtiers et aux contreparties au titre d'instruments financiers dérivés ouverts | 1(g)  | (50 701)              | (1 127 380)           |
| Dettes - Échéances inférieures à un an :   |       |                       |                       |
| Charges à payer  |       | (9 212 020)           | (9 442 789)           |
| Produits divers à payer  |       | (79 641)              | -                     |
| À payer sur achats d'investissements   |       | (761 068 972)         | (620 780 148)         |
| À payer sur rachats d'actions de fonds   |       | (36 838 006)          | (111 147 472)         |
| Provision d'impôt sur les plus-values de capital   |       | (4 715 377)           | (10 042 365)          |
|  |       | <b>(835 456 692)</b>  | <b>(779 481 365)</b>  |
| <b>Total des passifs circulants</b>  |       |                       |                       |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                  |       | <b>46 187 960 717</b> | <b>45 338 821 760</b> |

Pour le compte du Conseil d'administration

Administratrice  
Barbara Healy

Administratrice  
Jennifer Fox

24 juillet 2023

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## État du résultat global de la Société pour l'exercice clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD            | 2022<br>USD        |
|--|-------|------------------------|--------------------|
| Produits de dividendes   | 1(j)  | 612 590 309            | 537 771 008        |
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur   | 1(k)  | 553 150 893            | 432 015 960        |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat                 | 9     | (3 666 778 792)        | (243 178 724)      |
| Produits divers  |       | 1 779 349              | 1 305 054          |
| <b>Total des (charges)/revenus d'investissement</b>  |       | <b>(2 499 258 241)</b> | <b>727 913 298</b> |
| Charges opérationnelles  | 3     | (105 415 679)          | (114 220 249)      |
| Rendement négatif<br><b>(Perte)/Bénéfice net(te) pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>                         | 1(k)  | <b>(4 560 931)</b>     | <b>(4 822 492)</b> |
| <b>Charges financières</b>   |       |                        |                    |
| Charges d'intérêts   | 1(k)  | (164 466)              | (571 708)          |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables  | 7     | (541 146 666)          | (485 730 195)      |
| <b>(Perte)/Bénéfice pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(3 150 545 983)</b> | <b>122 568 654</b> |
| Impôt sur les plus-values de capital   | 2     | (5 054 417)            | (13 487 613)       |
| Retenue à la source sur produits d'investissement  | 2     | (84 323 135)           | (69 208 992)       |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(3 239 923 535)</b> | <b>39 872 049</b>  |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.



## État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'Actions de participation rachetables de la Société pour l'exercice clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD            | 2022<br>USD           |
|--|-------|------------------------|-----------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier                              |       | 45 338 821 760         | 43 417 992 366        |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(3 239 923 535)</b> | <b>39 872 049</b>     |
| <b>Opérations sur actions</b>  |       |                        |                       |
| Produits sur actions de participation rachetables émises   |       | 16 627 966 180         | 16 115 041 551        |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables   |       | (12 188 351 594)       | (13 626 768 777)      |
| Augmentation des actifs nets résultant d'opérations sur actions  |       | 4 439 614 586          | 2 488 272 774         |
| <b>Augmentation totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                                |       | <b>1 199 691 051</b>   | <b>2 528 144 823</b>  |
| Conversion de devises  | 1(c)  | (350 552 094)          | (607 315 429)         |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>                       |       | <b>46 187 960 717</b>  | <b>45 338 821 760</b> |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## État des flux de trésorerie de la Société pour l'exercice clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD            | 2022<br>USD            |
|--|-------|------------------------|------------------------|
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(3 239 923 535)</b> | <b>39 872 049</b>      |
| <b>Ajustement pour :</b>   |       |                        |                        |
| Variation de la trésorerie détenue par/à payer au courtier   |       | 1 777 514              | 498 554                |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat   |       | (1 041 460 037)        | (2 313 016 759)        |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés  |       | (59 673 045)           | (12 372 293)           |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>  |       | <b>(4 339 279 103)</b> | <b>(2 285 018 449)</b> |
| Variation des montants à recevoir  |       | (19 791 817)           | (8 077 904)            |
| Variation des montants à payer   |       | (5 417 127)            | 10 095 910             |
| <b>(Sorties)/Entrées de trésorerie sur opérations</b>  |       | <b>(25 208 944)</b>    | <b>2 018 006</b>       |
| <b>Sorties de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>   |       | <b>(4 364 488 047)</b> | <b>(2 283 000 443)</b> |
| <b>Activités de financement</b>  |       |                        |                        |
| Produits des souscriptions   | 5     | 16 669 530 406         | 16 039 124 485         |
| Paievements sur rachats  | 5     | (12 256 679 181)       | (13 803 861 349)       |
| <b>Trésorerie nette générée sur activités de financement</b>   |       | <b>4 412 851 225</b>   | <b>2 235 263 136</b>   |
| <b>Augmentation/(Diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>   |       | <b>48 363 178</b>      | <b>(47 737 307)</b>    |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier   |       | 247 410 206            | 298 822 349            |
| Conversion de devises  | 1(c)  | 295 079                | (3 674 836)            |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>  |       | <b>296 068 463</b>     | <b>247 410 206</b>     |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie - État de la situation financière  |       | 299 602 100            | 247 411 849            |
| Découverts bancaires - État de la situation financière   |       | (3 533 637)            | (1 643)                |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie - État des flux de trésorerie</b>   |       | <b>296 068 463</b>     | <b>247 410 206</b>     |
| <b>Informations supplémentaires</b>  |       |                        |                        |
| Impôts payés   |       | (84 662 175)           | (72 654 240)           |
| Intérêts reçus   |       | 619 453 778            | 620 650 706            |
| Intérêts payés   |       | (164 466)              | (571 708)              |
| Dividendes reçus   |       | 612 099 500            | 527 782 343            |
| Distributions payées   |       | (541 146 666)          | (485 730 195)          |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>EUR          | 2022<br>EUR          |
|---|-------|----------------------|----------------------|
| <b>Actifs circulants</b>  |       |                      |                      |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :            |       |                      |                      |
| Valeurs mobilières  | 1(e)  | 1 770 314 654        | 1 733 523 971        |
|   |       | <b>1 770 314 654</b> | <b>1 733 523 971</b> |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie</b>                                      |       |                      |                      |
| Créances :  |       |                      |                      |
| Intérêts à recevoir   | 1(f)  | 53 546 295           | 4 791 610            |
| À recevoir sur cessions d'investissements   |       | 13 931 877           | 13 199 678           |
|   |       | 24 205 237           | 43 527 478           |
| <b>Total des actifs circulants</b>  |       | <b>1 861 998 063</b> | <b>1 795 042 737</b> |
| <b>Passifs circulants</b>   |       |                      |                      |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :  |       |                      |                      |
| Charges à payer   |       | (299 916)            | (288 822)            |
| À payer sur achats d'investissements  |       | (68 557 909)         | (40 076 429)         |
| À payer sur rachats d'actions de fonds  |       | (6 907 374)          | (10 330 669)         |
| <b>Total des passifs circulants</b>   |       | <b>(75 765 199)</b>  | <b>(50 695 920)</b>  |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> |       |                      |                      |
|   |       | <b>1 786 232 864</b> | <b>1 744 346 817</b> |
| <b>Valeur liquidative par action</b>  |       |                      |                      |
|   |       | <b>2023</b>          | <b>2022</b>          |
|   |       | <b>2021</b>          |                      |
| Valeur liquidative par action   | 5     | 29,00 EUR            | 29,77 EUR            |
|   |       |                      | 30,22 EUR            |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>EUR         | 2022<br>EUR         |
|---|-------|---------------------|---------------------|
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 17 387 584          | 6 472 298           |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 9     | (47 790 469)        | (25 453 053)        |
| Produits divers   |       | 42 585              | 5 656               |
| <b>Total des charges d'investissement</b>   |       | <b>(30 360 300)</b> | <b>(18 975 099)</b> |
| Charges opérationnelles   | 3     | (3 344 290)         | (3 671 755)         |
| <b>Perte nette pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(33 704 590)</b> | <b>(22 646 854)</b> |
| <b>Charges financières</b>  |       |                     |                     |
| Charges d'intérêts  |       | (36 520)            | (67 375)            |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables   | 7     | (9 381 791)         | (3 334 931)         |
| <b>Perte pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(43 122 901)</b> | <b>(26 049 160)</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement   | 2     | (7 958)             | -                   |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(43 130 859)</b> | <b>(26 049 160)</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>EUR          | 2022<br>EUR          |
|---|----------------------|----------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier               | 1 744 346 817        | 2 008 982 347        |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(43 130 859)</b>  | <b>(26 049 160)</b>  |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                      |                      |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 850 082 783          | 891 307 784          |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (765 065 877)        | (1 129 894 154)      |
| Augmentation/(Diminution) des actifs nets résultant d'opérations sur actions  | 85 016 906           | (238 586 370)        |
| <b>Augmentation/(Diminution) totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>    | <b>41 886 047</b>    | <b>(264 635 530)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>        | <b>1 786 232 864</b> | <b>1 744 346 817</b> |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>EUR         | 2022<br>EUR          |
|---|-------|---------------------|----------------------|
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | (43 130 859)        | (26 049 160)         |
| <b>Ajustement pour :</b>  |       |                     |                      |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  |       | 11 013 038          | 237 074 746          |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   |       | <b>(32 117 821)</b> | <b>211 025 586</b>   |
| Variation des montants à recevoir   |       | (732 199)           | 2 739 648            |
| Variation des montants à payer  |       | 11 094              | (79 445)             |
| <b>(Sorties)/Entrées de trésorerie sur opérations</b>   |       | <b>(721 105)</b>    | <b>2 660 203</b>     |
| <b>(Sorties)/Entrées de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  |       | <b>(32 838 926)</b> | <b>213 685 789</b>   |
| <b>Activités de financement</b>   |       |                     |                      |
| Produits des souscriptions  | 5     | 850 082 783         | 891 307 784          |
| Paiements sur rachats   | 5     | (768 489 172)       | (1 137 699 866)      |
| <b>Trésorerie nette générée/(utilisée) sur activités de financement</b>   |       | <b>81 593 611</b>   | <b>(246 392 082)</b> |
| <b>Augmentation/(Diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>                                    |       | <b>48 754 685</b>   | <b>(32 706 293)</b>  |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  |       | 4 791 610           | 37 497 903           |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   |       | <b>53 546 295</b>   | <b>4 791 610</b>     |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |       |                     |                      |
| Impôts payés  |       | (7 958)             | -                    |
| Intérêts reçus  |       | 23 732 567          | 30 343 709           |
| Intérêts payés  |       | (36 520)            | (67 375)             |
| Distributions payées  |       | (9 381 791)         | (3 334 931)          |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement   | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %)</b>            |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %)</b>               |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %)</b>      |                  |                   | <b>(suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Euro – 99,11 %</b>  |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 99,11 %</b>  |                  |                   | <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 1 200 000 3.000% 2i Rete Gas SpA 16/07/2024                          | 1 189 200        | 0,07              | 900 000 0.750% Air Liquide Finance SA 13/06/2024                        | 873 576          | 0,05              |
| 700 000 2.195% 2i Rete Gas SpA 11/09/2025                            | 673 134          | 0,04              | 900 000 1.000% Air Liquide Finance SA 02/04/2025                        | 862 191          | 0,05              |
| 1 050 000 0.950% 3M Co 15/05/2023                                    | 1 047 197        | 0,06              | 700 000 1.250% Air Liquide Finance SA 03/06/2025                        | 679 280          | 0,04              |
| 500 000 0.375% Aareal Bank AG 10/04/2024                             | 476 115          | 0,03              | 600 000 2.375% Air Liquide SA 06/09/2023                                | 597 108          | 0,03              |
| 1 100 000 4.500% Aareal Bank AG 25/07/2025                           | 1 073 006        | 0,06              | 500 000 1.000% Air Products and Chemicals Inc 12/02/2025                | 480 245          | 0,03              |
| 1 200 000 0.625% ABB Finance BV 03/05/2023                           | 1 197 396        | 0,07              | 1 800 000 2.375% Airbus SE 02/04/2024                                   | 1 783 512        | 0,10              |
| 1 300 000 0.625% ABB Finance BV 31/03/2024                           | 1 263 782        | 0,07              | 500 000 1.625% Airbus SE 07/04/2025                                     | 482 070          | 0,03              |
| 1 200 000 0.750% ABB Finance BV 16/05/2024                           | 1 166 304        | 0,07              | 1 250 000 1.125% Akelius Residential Property AB 14/03/2024             | 1 204 150        | 0,07              |
| 1 875 000 0.875% Abbott Ireland Financing DAC 27/09/2023             | 1 852 819        | 0,10              | 700 000 1.750% Akelius Residential Property AB 07/02/2025               | 652 050          | 0,04              |
| 1 100 000 0.100% Abbott Ireland Financing DAC 19/11/2024             | 1 043 229        | 0,06              | 800 000 1.750% Akzo Nobel NV 07/11/2024                                 | 782 488          | 0,04              |
| 900 000 1.500% AbbVie Inc 15/11/2023                                 | 889 497          | 0,05              | 600 000 1.125% Albemarle New Holding GmbH 25/11/2025                    | 559 932          | 0,03              |
| 2 500 000 1.375% AbbVie Inc 17/05/2024                               | 2 440 875        | 0,14              | 800 000 0.375% ALD SA 18/07/2023  | 793 432          | 0,04              |
| 1 106 000 1.250% AbbVie Inc 01/06/2024                               | 1 077 277        | 0,06              | 700 000 0.375% ALD SA 19/10/2023  | 687 498          | 0,04              |
| 1 900 000 3.750% Abertis Infraestructuras SA 20/06/2023              | 1 901 995        | 0,11              | 1 200 000 0.000% ALD SA 23/02/2024                                      | 1 158 300        | 0,06              |
| 900 000 0.625% Abertis Infraestructuras SA 15/07/2025                | 841 725          | 0,05              | 1 500 000 4.750% ALD SA 13/10/2025                                      | 1 519 875        | 0,09              |
| 2 000 000 0.500% ABN AMRO Bank NV 17/07/2023                         | 1 984 480        | 0,11              | 1 200 000 1.250% ALD SA 02/03/2026                                      | 1 106 376        | 0,06              |
| 939 000 2.500% ABN AMRO Bank NV 29/11/2023                           | 934 136          | 0,05              | 910 000 0.250% Alfa Laval Treasury International AB 25/06/2024          | 868 841          | 0,05              |
| 2 609 000 0.875% ABN AMRO Bank NV 15/01/2024                         | 2 555 489        | 0,14              | 1 500 000 0.250% Allianz Finance II BV 06/06/2023                       | 1 492 680        | 0,08              |
| 2 800 000 1.000% ABN AMRO Bank NV 16/04/2025                         | 2 660 224        | 0,15              | 500 000 0.000% Allianz Finance II BV 14/01/2025                         | 472 140          | 0,03              |
| 1 500 000 0.875% ABN AMRO Bank NV 22/04/2025                         | 1 419 420        | 0,08              | 1 100 000 0.875% Allianz Finance II BV 15/01/2026                       | 1 033 901        | 0,06              |
| 2 300 000 1.250% ABN AMRO Bank NV 28/05/2025                         | 2 181 481        | 0,12              | 3 200 000 2.241% Allianz SE 07/07/2045                                  | 3 010 528        | 0,17              |
| 1 600 000 3.625% ABN AMRO Bank NV 10/01/2026                         | 1 589 760        | 0,09              | 2 800 000 4.750% Allianz SE (Perpetual)                                 | 2 793 952        | 0,16              |
| 1 000 000 3.625% Achmea BV 29/11/2025                                | 997 400          | 0,06              | 2 300 000 3.375% Allianz SE (Perpetual)                                 | 2 243 696        | 0,13              |
| 700 000 6.000% Achmea BV 04/04/2043                                  | 700 000          | 0,04              | 500 000 2.064% Alpha Trains Finance SA 30/06/2030                       | 469 365          | 0,03              |
| 1 700 000 4.250% Achmea BV (Perpetual)                               | 1 658 248        | 0,09              | 1 000 000 2.125% alstria office REIT-AG 12/04/2023                      | 995 490          | 0,06              |
| 700 000 1.000% Adecco International Financial Services BV 02/12/2024 | 669 480          | 0,04              | 200 000 0.500% alstria office REIT-AG 26/09/2025                        | 165 024          | 0,01              |
| 1 000 000 0.000% adidas AG 09/09/2024                                | 954 300          | 0,05              | 1 400 000 1.700% Altria Group Inc 15/06/2025                            | 1 336 216        | 0,07              |
| 900 000 3.000% adidas AG 21/11/2025                                  | 895 095          | 0,05              | 200 000 0.875% Amadeus IT Group SA 18/09/2023                           | 197 444          | 0,01              |
| 700 000 0.625% Aegon Bank NV 21/06/2024                              | 674 009          | 0,04              | 900 000 2.500% Amadeus IT Group SA 20/05/2024                           | 886 284          | 0,05              |
| 600 000 1.000% Aegon NV 08/12/2023                                   | 589 596          | 0,03              | 1 347 000 3.259% America Movil SAB de CV 22/07/2023                     | 1 346 151        | 0,08              |
| 1 500 000 4.000% Aegon NV 25/04/2044                                 | 1 470 450        | 0,08              | 1 418 000 1.500% America Movil SAB de CV 10/03/2024                     | 1 387 017        | 0,08              |
| 1 400 000 1.250% AIB Group PLC 28/05/2024                            | 1 356 404        | 0,08              |   |                  |                   |
| 800 000 2.250% AIB Group PLC 03/07/2025                              | 768 864          | 0,04              |   |                  |                   |
| 1 300 000 3.625% AIB Group PLC 04/07/2026                            | 1 276 340        | 0,07              |   |                  |                   |
| 900 000 1.875% Air Liquide Finance SA 05/06/2024                     | 884 862          | 0,05              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>                |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>          |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>  |                  |                   | <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 900 000 0.750% American Honda Finance Corp 17/01/2024                            | 880 722          | 0,05              | 1 100 000 1.500% Arkema SA 20/01/2025                                   | 1 062 479        | 0,06              |
| 1 700 000 1.950% American Honda Finance Corp 18/10/2024                          | 1 659 506        | 0,09              | 1 000 000 2.750% Arkema SA (Perpetual)                                  | 956 110          | 0,05              |
| 1 600 000 0.750% American Medical Systems Europe BV 08/03/2025                   | 1 514 640        | 0,08              | 1 200 000 1.000% Arountown SA 07/01/2025                                | 997 152          | 0,06              |
| 800 000 1.375% American Tower Corp 04/04/2025                                    | 762 336          | 0,04              | 1 300 000 0.625% Arountown SA 09/07/2025                                | 1 049 282        | 0,06              |
| 1 300 000 2.000% Amgen Inc 25/02/2026  | 1 246 284        | 0,07              | 1 300 000 2.125% Arountown SA (Perpetual)                               | 445 678          | 0,02              |
| 1 400 000 3.250% Anglo American Capital PLC 03/04/2023                           | 1 400 000        | 0,08              | 800 000 2.875% Arountown SA (Perpetual)                                 | 279 960          | 0,02              |
| 1 000 000 1.625% Anglo American Capital PLC 18/09/2025                           | 945 200          | 0,05              | 1 000 000 3.375% Arountown SA (Perpetual)                               | 446 710          | 0,03              |
| 900 000 1.625% Anglo American Capital PLC 11/03/2026                             | 848 862          | 0,05              | 1 500 000 0.000% Arval Service Lease SA/France 30/09/2024               | 1 416 915        | 0,08              |
| 1 000 000 2.875% Anheuser-Busch InBev SA/NV 25/09/2024                           | 999 730          | 0,06              | 1 500 000 0.875% Arval Service Lease SA/France 17/02/2025               | 1 413 225        | 0,08              |
| 1 700 000 2.700% Anheuser-Busch InBev SA/NV 31/03/2026                           | 1 669 502        | 0,09              | 900 000 0.000% Arval Service Lease SA/France 01/10/2025                 | 815 058          | 0,05              |
| 700 000 1.125% ANZ New Zealand Int'l Ltd/London 20/03/2025                       | 667 821          | 0,04              | 900 000 3.375% Arval Service Lease SA/France 04/01/2026                 | 885 816          | 0,05              |
| 1 300 000 1.750% AP Moller - Maersk A/S 16/03/2026                               | 1 224 600        | 0,07              | 1 770 000 0.010% Asahi Group Holdings Ltd 19/04/2024                    | 1 702 598        | 0,10              |
| 1 700 000 1.375% Apple Inc 17/01/2024  | 1 676 234        | 0,09              | 1 900 000 0.155% Asahi Group Holdings Ltd 23/10/2024                    | 1 797 419        | 0,10              |
| 2 700 000 0.875% Apple Inc 24/05/2025  | 2 578 581        | 0,14              | 900 000 0.750% ASB Finance Ltd/London 13/03/2024                        | 873 342          | 0,05              |
| 1 400 000 0.000% Apple Inc 15/11/2025  | 1 293 152        | 0,07              | 1 200 000 3.375% ASML Holding NV 19/09/2023                             | 1 199 496        | 0,07              |
| 1 000 000 1.500% APRR SA 15/01/2024  | 985 380          | 0,06              | 800 000 5.125% ASR Nederland NV 29/09/2045                              | 785 608          | 0,04              |
| 1 900 000 1.875% APRR SA 15/01/2025  | 1 847 655        | 0,10              | 800 000 5.000% ASR Nederland NV (Perpetual)                             | 789 216          | 0,04              |
| 1 100 000 1.500% Aptiv PLC 10/03/2025  | 1 052 216        | 0,06              | 3 100 000 5.125% Assicurazioni Generali SpA 16/09/2024                  | 3 170 122        | 0,18              |
| 882 000 4.250% Aquarius & Investments PLC for Zurich Insurance Co Ltd 02/10/2043 | 873 656          | 0,05              | 3 200 000 4.596% Assicurazioni Generali SpA (Perpetual)                 | 3 105 760        | 0,18              |
| 1 300 000 1.000% ArcelorMittal SA 19/05/2023                                     | 1 294 709        | 0,07              | 800 000 3.375% ASTM SpA 13/02/2024                                      | 796 552          | 0,04              |
| 900 000 2.250% ArcelorMittal SA 17/01/2024                                       | 890 982          | 0,05              | 1 600 000 0.750% AstraZeneca PLC 12/05/2024                             | 1 556 912        | 0,09              |
| 1 500 000 1.750% ArcelorMittal SA 19/11/2025                                     | 1 418 055        | 0,08              | 500 000 2.750% AT&T Inc 19/05/2023                                      | 499 625          | 0,03              |
| 1 000 000 1.750% Archer-Daniels-Midland Co 23/06/2023                            | 995 900          | 0,06              | 700 000 1.050% AT&T Inc 05/09/2023                                      | 693 455          | 0,04              |
| 1 100 000 1.000% Archer-Daniels-Midland Co 12/09/2025                            | 1 036 101        | 0,06              | 2 100 000 1.300% AT&T Inc 05/09/2023                                    | 2 081 898        | 0,12              |
| 800 000 1.000% Argenta Spaarbank NV 06/02/2024                                   | 779 888          | 0,04              | 1 005 000 1.950% AT&T Inc 15/09/2023                                    | 997 674          | 0,06              |
| 900 000 1.000% Argenta Spaarbank NV 13/10/2026                                   | 816 003          | 0,05              | 2 800 000 2.400% AT&T Inc 15/03/2024                                    | 2 765 985        | 0,15              |
| 1 200 000 1.125% Argentum Netherlands BV for Givaudan SA 17/09/2025              | 1 126 656        | 0,06              | 2 700 000 3.500% AT&T Inc 17/12/2025                                    | 2 695 228        | 0,15              |
| 1 300 000 4.375% Argentum Netherlands BV for Swiss Life AG (Perpetual)           | 1 245 907        | 0,07              | 500 000 0.250% AT&T Inc 04/03/2026                                      | 454 600          | 0,03              |
| 600 000 0.625% Arion Banki HF 27/05/2024   | 572 226          | 0,03              | 400 000 1.875% Athene Global Funding 23/06/2023                         | 397 128          | 0,02              |
| 600 000 4.875% Arion Banki HF 21/12/2024   | 590 814          | 0,03              | 1 400 000 1.241% Athene Global Funding 08/04/2024                       | 1 338 806        | 0,07              |
| 600 000 0.375% Arion Banki HF 14/07/2025   | 525 768          | 0,03              | 600 000 1.125% Athene Global Funding 02/09/2025                         | 544 692          | 0,03              |
|  |                  |                   | 800 000 2.000% Aurizon Network Pty Ltd 18/09/2024                       | 778 032          | 0,04              |
|  |                  |                   | 1 200 000 1.250% Ausgrid Finance Pty Ltd 30/07/2025                     | 1 136 712        | 0,06              |



## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR   | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR  | % des actifs nets |
|---|--|-------------------|---|---|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |   |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |   |                   |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |  |                   | <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |   |                   |
| 600 000   | 3.000% AusNet Services Holdings Pty Ltd 13/02/2024             | 594 606 0,03      | 1 400 000   | 1.625% Banco de Sabadell SA 07/03/2024                  | 1 368 948 0,08    |
| 3 000 000   | 3.652% Australia & New Zealand Banking Group Ltd 20/01/2026    | 2 986 470 0,17    | 1 900 000   | 0.875% Banco de Sabadell SA 22/07/2025                  | 1 762 150 0,10    |
| 1 300 000   | 1.125% Australia & New Zealand Banking Group Ltd 21/11/2029    | 1 223 872 0,07    | 900 000   | 0.625% Banco de Sabadell SA 07/11/2025                  | 847 737 0,05      |
| 900 000   | 3.125% Australia Pacific Airports Melbourne Pty Ltd 26/09/2023 | 896 877 0,05      | 400 000   | 1.125% Banco de Sabadell SA 11/03/2027                  | 362 171 0,02      |
| 900 000   | 1.750% Australia Pacific Airports Melbourne Pty Ltd 15/10/2024 | 864 558 0,05      | 2 200 000   | 0.250% Banco Santander SA 19/06/2024                    | 2 108 480 0,12    |
| 1 100 000   | 0.750% Autoliv Inc 26/06/2023                                  | 1 093 532 0,06    | 2 200 000   | 1.125% Banco Santander SA 17/01/2025                    | 2 098 426 0,12    |
| 1 000 000   | 2.950% Autoroutes du Sud de la France SA 17/01/2024            | 997 010 0,06      | 2 600 000   | 0.100% Banco Santander SA 26/01/2025                    | 2 521 168 0,14    |
| 1 800 000   | 5.875% Autostrade per l'Italia SpA 09/06/2024                  | 1 838 628 0,10    | 2 600 000   | 2.500% Banco Santander SA 18/03/2025                    | 2 532 842 0,14    |
| 700 000   | 4.375% Autostrade per l'Italia SpA 16/09/2025                  | 702 702 0,04      | 2 600 000   | 1.375% Banco Santander SA 05/01/2026                    | 2 422 550 0,14    |
| 800 000   | 1.875% Autostrade per l'Italia SpA 04/11/2025                  | 753 856 0,04      | 3 300 000   | 3.750% Banco Santander SA 16/01/2026                    | 3 299 010 0,18    |
| 800 000   | 1.250% Avery Dennison Corp 03/03/2025                          | 751 776 0,04      | 3 300 000   | 3.625% Banco Santander SA 27/09/2026                    | 3 272 511 0,18    |
| 500 000   | 0.625% Aviva PLC 27/10/2023                                    | 490 845 0,03      | 300 000   | 0.500% Banco Santander SA 24/03/2027                    | 268 827 0,02      |
| 1 100 000   | 6.125% Aviva PLC 05/07/2043                                    | 1 101 056 0,06    | 1 000 000   | 0.000% Bank Julius Baer & Co AG 25/06/2024              | 949 010 0,05      |
| 1 300 000   | 3.875% Aviva PLC 03/07/2044                                    | 1 268 670 0,07    | 2 434 000   | 0.750% Bank of America Corp 26/07/2023                  | 2 413 968 0,14    |
| 1 100 000   | 3.375% Aviva PLC 04/12/2045                                    | 1 036 992 0,06    | 2 100 000   | 2.375% Bank of America Corp 19/06/2024                  | 2 068 101 0,12    |
| 1 875 000   | 5.125% AXA SA 04/07/2043                                       | 1 874 231 0,10    | 2 450 000   | 1.379% Bank of America Corp 07/02/2025                  | 2 396 467 0,13    |
| 1 700 000   | 3.875% AXA SA (Perpetual)                                      | 1 624 724 0,09    | 1 300 000   | 1.375% Bank of America Corp 26/03/2025                  | 1 249 846 0,07    |
| 1 700 000   | 3.941% AXA SA (Perpetual)                                      | 1 649 391 0,09    | 2 400 000   | 0.808% Bank of America Corp 09/05/2026                  | 2 242 320 0,13    |
| 800 000   | 1.625% Azimut Holding SpA 12/12/2024                           | 766 104 0,04      | 3 000 000   | 1.949% Bank of America Corp 27/10/2026                  | 2 845 530 0,16    |
| 1 250 000   | 2.750% Bacardi Ltd 03/07/2023                                  | 1 244 588 0,07    | 1 200 000   | 1.375% Bank of Ireland Group PLC 29/08/2023             | 1 189 188 0,07    |
| 500 000   | 5.035% Banca Mediolanum SpA 22/01/2027                         | 502 425 0,03      | 1 232 000   | 0.750% Bank of Ireland Group PLC 08/07/2024             | 1 221 134 0,07    |
| 2 000 000   | 1.125% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 28/02/2024           | 1 951 780 0,11    | 1 000 000   | 1.000% Bank of Ireland Group PLC 25/11/2025             | 949 520 0,05      |
| 2 100 000   | 0.375% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 02/10/2024           | 1 997 856 0,11    | 1 900 000   | 1.875% Bank of Ireland Group PLC 05/06/2026             | 1 795 272 0,10    |
| 1 800 000   | 1.375% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 14/05/2025           | 1 714 626 0,10    | 1 800 000   | 0.500% Bank of Nova Scotia 30/04/2024                   | 1 738 404 0,10    |
| 1 800 000   | 0.750% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 04/06/2025           | 1 693 188 0,09    | 1 200 000   | 0.875% Bankinter SA 05/03/2024                          | 1 167 840 0,07    |
| 1 800 000   | 1.750% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 26/11/2025           | 1 715 310 0,10    | 2 500 000   | 0.750% Banque Federative du Credit Mutuel SA 15/06/2023 | 2 488 025 0,14    |
| 1 700 000   | 0.125% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 24/03/2027           | 1 525 342 0,09    |   |   |                   |
| 1 300 000   | 2.575% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 22/02/2029           | 1 269 125 0,07    |   |   |                   |
| 1 600 000   | 1.000% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 16/01/2030           | 1 468 160 0,08    |   |   |                   |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR  | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets   |           |      |
|---|---|-------------------|---|------------------|---|-----------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |   |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                  |   |           |      |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |   |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                  |   |           |      |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |   |                   | <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                  |   |           |      |
| 2 100 000   | 3.000% Banque Federative du Credit Mutuel SA 28/11/2023 | 2 092 818         | 0,12  | 2 300 000        | 0.050% Bayer AG 31/12/2025  | 2 160 919 | 0,12 |
| 3 000 000   | 0.125% Banque Federative du Credit Mutuel SA 05/02/2024 | 2 914 860         | 0,16  | 700 000          | 1.250% Bayer Capital Corp BV 13/11/2023                             | 690 823   | 0,04 |
| 3 000 000   | 2.625% Banque Federative du Credit Mutuel SA 18/03/2024 | 2 969 340         | 0,17  | 550 000          | 1.401% Becton Dickinson and Co 24/05/2023                           | 548 548   | 0,03 |
| 1 700 000   | 3.000% Banque Federative du Credit Mutuel SA 21/05/2024 | 1 676 557         | 0,09  | 400 000          | 0.000% Becton Dickinson and Co 13/08/2023                           | 395 132   | 0,02 |
| 2 400 000   | 1.250% Banque Federative du Credit Mutuel SA 14/01/2025 | 2 293 584         | 0,13  | 900 000          | 0.034% Becton Dickinson and Co 13/08/2025                           | 829 899   | 0,05 |
| 3 000 000   | 0.010% Banque Federative du Credit Mutuel SA 07/03/2025 | 2 795 130         | 0,16  | 1 628 000        | 0.632% Becton Dickinson Euro Finance Sarl 04/06/2023                | 1 620 658 | 0,09 |
| 3 000 000   | 1.000% Banque Federative du Credit Mutuel SA 23/05/2025 | 2 837 760         | 0,16  | 900 000          | 0.625% Belfius Bank SA 30/08/2023                                   | 889 875   | 0,05 |
| 2 600 000   | 0.750% Banque Federative du Credit Mutuel SA 17/07/2025 | 2 424 006         | 0,14  | 1 000 000        | 1.000% Belfius Bank SA 26/10/2024                                   | 955 340   | 0,05 |
| 1 700 000   | 3.000% Banque Federative du Credit Mutuel SA 11/09/2025 | 1 659 149         | 0,09  | 700 000          | 0.375% Belfius Bank SA 02/09/2025                                   | 642 761   | 0,04 |
| 1 700 000   | 1.625% Banque Federative du Credit Mutuel SA 19/01/2026 | 1 602 675         | 0,09  | 800 000          | 0.010% Belfius Bank SA 15/10/2025                                   | 727 728   | 0,04 |
| 1 700 000   | 2.375% Banque Federative du Credit Mutuel SA 24/03/2026 | 1 624 503         | 0,09  | 1 000 000        | 0.375% Belfius Bank SA 13/02/2026                                   | 903 710   | 0,05 |
| 900 000   | 2.250% Barclays Bank PLC 10/06/2024                     | 887 256           | 0,05  | 900 000          | 1.300% Berkshire Hathaway Inc 15/03/2024                            | 882 396   | 0,05 |
| 1 391 000   | 1.500% Barclays PLC 03/09/2023                          | 1 378 425         | 0,08  | 2 200 000        | 0.000% Berkshire Hathaway Inc 12/03/2025                            | 2 054 888 | 0,12 |
| 2 000 000   | 1.875% Barclays PLC 08/12/2023                          | 1 975 980         | 0,11  | 1 100 000        | 0.375% Berlin Hyp AG 28/08/2023                                     | 1 086 470 | 0,06 |
| 4 011 000   | 3.375% Barclays PLC 02/04/2025                          | 3 977 348         | 0,22  | 700 000          | 0.500% Berlin Hyp AG 26/09/2023                                     | 689 829   | 0,04 |
| 1 300 000   | 0.750% Barclays PLC 09/06/2025                          | 1 247 571         | 0,07  | 1 200 000        | 1.250% Berlin Hyp AG 22/01/2025                                     | 1 145 976 | 0,06 |
| 600 000   | 1.375% Barclays PLC 24/01/2026                          | 567 690           | 0,03  | 600 000          | 1.000% Berlin Hyp AG 05/02/2026                                     | 551 046   | 0,03 |
| 2 000 000   | 2.885% Barclays PLC 31/01/2027                          | 1 904 940         | 0,11  | 1 200 000        | 1.000% Berry Global Inc 15/01/2025                                  | 1 137 240 | 0,06 |
| 1 700 000   | 1.125% Barclays PLC 22/03/2031                          | 1 479 816         | 0,08  | 700 000          | 1.750% Bertelsmann SE & Co KGaA 14/10/2024                          | 680 988   | 0,04 |
| 700 000   | 2.375% Barry Callebaut Services NV 24/05/2024           | 687 673           | 0,04  | 800 000          | 1.250% Bertelsmann SE & Co KGaA 29/09/2025                          | 759 136   | 0,04 |
| 1 600 000   | 0.101% BASF SE 05/06/2023                               | 1 592 064         | 0,09  | 950 000          | 3.000% BHP Billiton Finance Ltd 29/05/2024                          | 944 633   | 0,05 |
| 800 000   | 2.500% BASF SE 22/01/2024                               | 796 488           | 0,04  | 1 400 000        | 1.250% BlackRock Inc 06/05/2025                                     | 1 331 470 | 0,07 |
| 1 600 000   | 0.875% BASF SE 22/05/2025                               | 1 533 888         | 0,09  | 600 000          | 2.000% Blackstone Holdings Finance Co LLC 19/05/2025                | 569 388   | 0,03 |
| 1 700 000   | 0.750% BASF SE 17/03/2026                               | 1 588 808         | 0,09  | 1 000 000        | 0.500% Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 12/09/2023 | 977 590   | 0,05 |
| 1 800 000   | 1.125% BAT Capital Corp 16/11/2023                      | 1 773 000         | 0,10  | 750 000          | 0.125% Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 20/10/2023 | 726 345   | 0,04 |
| 1 400 000   | 0.875% BAT International Finance PLC 13/10/2023         | 1 379 448         | 0,08  | 900 000          | 2.000% Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 15/02/2024 | 867 654   | 0,05 |
| 1 200 000   | 2.750% BAT International Finance PLC 25/03/2025         | 1 177 668         | 0,07  | 1 600 000        | 2.200% Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 24/07/2025 | 1 458 432 | 0,08 |
| 1 500 000   | 2.375% BAT Netherlands Finance BV 07/10/2024            | 1 468 110         | 0,08  | 1 750 000        | 0.000% BMW Finance NV 14/04/2023                                    | 1 748 477 | 0,10 |
| 800 000   | 2.375% BAWAG Group AG 26/03/2029                        | 750 856           | 0,04  | 1 984 000        | 0.375% BMW Finance NV 10/07/2023                                    | 1 969 160 | 0,11 |
| 1 376 000   | 0.400% Baxter International Inc 15/05/2024              | 1 323 795         | 0,07  | 1 900 000        | 0.625% BMW Finance NV 06/10/2023                                    | 1 875 813 | 0,11 |
| 1 000 000   | 1.300% Baxter International Inc 30/05/2025              | 947 000           | 0,05  | 1 425 000        | 2.625% BMW Finance NV 17/01/2024                                    | 1 419 300 | 0,08 |
| 2 600 000   | 0.375% Bayer AG 06/07/2024                              | 2 497 456         | 0,14  | 1 200 000        | 0.750% BMW Finance NV 15/04/2024                                    | 1 172 208 | 0,07 |
|   |   |                   |   | 1 400 000        | 0.750% BMW Finance NV 12/07/2024                                    | 1 359 834 | 0,08 |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 2 000 000 1.000% BMW Finance NV 14/11/2024                              | 1 936 220           | 0,11                    |
| 1 200 000 1.000% BMW Finance NV 21/01/2025                              | 1 158 864           | 0,06                    |
| 2 900 000 0.500% BMW Finance NV 22/02/2025                              | 2 771 646           | 0,16                    |
| 1 400 000 0.875% BMW Finance NV 03/04/2025                              | 1 344 476           | 0,08                    |
| 1 300 000 1.000% BMW Finance NV 29/08/2025                              | 1 242 956           | 0,07                    |
| 1 200 000 0.000% BMW Finance NV 11/01/2026                              | 1 104 564           | 0,06                    |
| 2 300 000 1.000% BNP Paribas Cardif SA 29/11/2024                       | 2 179 907           | 0,12                    |
| 700 000 4.032% BNP Paribas Cardif SA (Perpetual)                        | 669 025             | 0,04                    |
| 2 889 000 2.875% BNP Paribas SA 26/09/2023                              | 2 884 869           | 0,16                    |
| 1 600 000 1.125% BNP Paribas SA 10/10/2023                              | 1 580 848           | 0,09                    |
| 1 508 000 1.125% BNP Paribas SA 22/11/2023                              | 1 486 466           | 0,08                    |
| 1 550 000 1.000% BNP Paribas SA 17/04/2024                              | 1 507 251           | 0,08                    |
| 1 714 000 2.375% BNP Paribas SA 20/05/2024                              | 1 694 220           | 0,09                    |
| 1 300 000 1.000% BNP Paribas SA 27/06/2024                              | 1 256 658           | 0,07                    |
| 1 500 000 1.125% BNP Paribas SA 28/08/2024                              | 1 448 145           | 0,08                    |
| 2 700 000 2.375% BNP Paribas SA 17/02/2025                              | 2 615 085           | 0,15                    |
| 1 600 000 1.250% BNP Paribas SA 19/03/2025                              | 1 525 440           | 0,09                    |
| 1 800 000 0.500% BNP Paribas SA 15/07/2025                              | 1 719 990           | 0,10                    |
| 2 200 000 1.500% BNP Paribas SA 17/11/2025                              | 2 098 338           | 0,12                    |
| 1 100 000 2.750% BNP Paribas SA 27/01/2026                              | 1 059 454           | 0,06                    |
| 1 000 000 1.625% BNP Paribas SA 23/02/2026                              | 952 070             | 0,05                    |
| 1 300 000 0.500% BNP Paribas SA 04/06/2026                              | 1 207 076           | 0,07                    |
| 3 800 000 2.125% BNP Paribas SA 23/01/2027                              | 3 581 424           | 0,20                    |
| 1 000 000 2.375% BNP Paribas SA 20/11/2030                              | 933 970             | 0,05                    |
| 1 105 000 0.500% BNZ International Funding Ltd/ London 13/05/2023       | 1 101 740           | 0,06                    |
| 1 100 000 0.375% BNZ International Funding Ltd/ London 14/09/2024       | 1 049 488           | 0,06                    |
| 1 700 000 2.375% Booking Holdings Inc 23/09/2024                        | 1 673 310           | 0,09                    |
| 1 800 000 0.100% Booking Holdings Inc 08/03/2025                        | 1 686 078           | 0,09                    |
| 100 000 1.750% Borealis AG 10/12/2025                                   | 97 036              | 0,01                    |
| 200 000 1.117% BP Capital Markets PLC 25/01/2024                        | 196 640             | 0,01                    |
| 1 650 000 1.876% BP Capital Markets PLC 07/04/2024                      | 1 625 097           | 0,09                    |
| 200 000 0.900% BP Capital Markets PLC 03/07/2024                        | 193 942             | 0,01                    |
| 1 100 000 0.830% BP Capital Markets PLC 19/09/2024                      | 1 062 116           | 0,06                    |
| 1 200 000 1.953% BP Capital Markets PLC 03/03/2025                      | 1 170 600           | 0,07                    |
| 800 000 1.077% BP Capital Markets PLC 26/06/2025                        | 762 208             | 0,04                    |

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>                       |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>                 |                     |                         |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 1 800 000 2.972% BP Capital Markets PLC 27/02/2026                                      | 1 782 828           | 0,10                    |
| 1 500 000 4.625% BPCE SA 18/07/2023   | 1 502 655           | 0,08                    |
| 2 000 000 0.625% BPCE SA 26/09/2023   | 1 973 460           | 0,11                    |
| 1 300 000 0.375% BPCE SA 05/10/2023   | 1 280 266           | 0,07                    |
| 1 600 000 2.875% BPCE SA 16/01/2024   | 1 592 656           | 0,09                    |
| 1 900 000 0.875% BPCE SA 31/01/2024   | 1 856 262           | 0,10                    |
| 2 300 000 1.000% BPCE SA 15/07/2024   | 2 225 411           | 0,12                    |
| 1 200 000 3.000% BPCE SA 19/07/2024   | 1 186 692           | 0,07                    |
| 2 800 000 0.625% BPCE SA 26/09/2024   | 2 671 172           | 0,15                    |
| 1 400 000 0.125% BPCE SA 04/12/2024   | 1 323 728           | 0,07                    |
| 1 800 000 1.000% BPCE SA 01/04/2025   | 1 701 666           | 0,10                    |
| 2 800 000 0.625% BPCE SA 28/04/2025   | 2 628 108           | 0,15                    |
| 2 600 000 0.250% BPCE SA 15/01/2026   | 2 364 908           | 0,13                    |
| 1 000 000 0.375% BPCE SA 02/02/2026   | 909 400             | 0,05                    |
| 1 300 000 1.375% BPCE SA 23/03/2026   | 1 212 328           | 0,07                    |
| 900 000 2.375% Brambles Finance Ltd 12/06/2024  | 883 809             | 0,05                    |
| 1 400 000 1.125% Brenntag Finance BV 27/09/2025   | 1 323 994           | 0,07                    |
| 500 000 1.875% Brisa-Concessao Rodoviaria SA 30/04/2025                                 | 482 040             | 0,03                    |
| 1 000 000 1.000% Bristol-Myers Squibb Co 15/05/2025                                     | 952 990             | 0,05                    |
| 400 000 1.000% British Telecommunications PLC 23/06/2024                                | 388 620             | 0,02                    |
| 1 850 000 1.000% British Telecommunications PLC 21/11/2024                              | 1 774 279           | 0,10                    |
| 1 600 000 0.500% British Telecommunications PLC 12/09/2025                              | 1 489 536           | 0,08                    |
| 2 300 000 1.750% British Telecommunications PLC 10/03/2026                              | 2 182 954           | 0,13                    |
| 600 000 1.000% Brussels Airport Co SA 03/05/2024  | 582 402             | 0,03                    |
| 1 150 000 1.850% Bunge Finance Europe BV 16/06/2023                                     | 1 145 722           | 0,06                    |
| 500 000 1.000% CA Immobilien Anlagen AG 27/10/2025                                      | 438 147             | 0,02                    |
| 1 400 000 0.625% Cadent Finance PLC 22/09/2024  | 1 340 962           | 0,08                    |
| 1 300 000 6.375% Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama (Perpetual) | 1 308 970           | 0,07                    |
| 1 600 000 0.750% CaixaBank SA 18/04/2023  | 1 598 640           | 0,09                    |
| 1 600 000 1.750% CaixaBank SA 24/10/2023  | 1 583 008           | 0,09                    |
| 2 100 000 2.375% CaixaBank SA 01/02/2024  | 2 075 218           | 0,12                    |
| 1 300 000 0.875% CaixaBank SA 25/03/2024  | 1 261 923           | 0,07                    |
| 1 800 000 1.125% CaixaBank SA 17/05/2024  | 1 745 676           | 0,10                    |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>                   |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>            |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>             |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>      |                  |                   |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 800 000 1.000% CaixaBank SA 25/06/2024  | 770 312          | 0,04              | 200 000 0.875% Cie de Saint-Gobain 21/09/2023                                | 197 774          | 0,01              |
| 1 600 000 0.625% CaixaBank SA 01/10/2024  | 1 525 136        | 0,09              | 1 700 000 0.625% Cie de Saint-Gobain 15/03/2024                              | 1 655 528        | 0,09              |
| 1 600 000 0.375% CaixaBank SA 03/02/2025  | 1 507 520        | 0,08              | 1 600 000 1.000% Cie de Saint-Gobain 17/03/2025                              | 1 530 720        | 0,09              |
| 1 700 000 1.125% CaixaBank SA 27/03/2026  | 1 585 573        | 0,09              | 900 000 1.625% Cie de Saint-Gobain 10/08/2025                                | 859 590          | 0,05              |
| 1 500 000 1.625% CaixaBank SA 13/04/2026  | 1 418 355        | 0,08              | 1 300 000 1.125% Cie de Saint-Gobain 23/03/2026                              | 1 215 512        | 0,07              |
| 1 600 000 0.750% CaixaBank SA 10/07/2026  | 1 491 952        | 0,08              | 1 200 000 0.375% Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 07/02/2025 | 1 135 518        | 0,06              |
| 1 500 000 0.375% CaixaBank SA 18/11/2026  | 1 351 125        | 0,08              | 1 300 000 0.875% Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 03/09/2025     | 1 227 915        | 0,07              |
| 1 600 000 2.750% CaixaBank SA 14/07/2028  | 1 584 160        | 0,09              | 3 002 000 0.750% Citigroup Inc 26/10/2023                                    | 2 953 758        | 0,17              |
| 2 000 000 3.750% CaixaBank SA 15/02/2029  | 1 967 240        | 0,11              | 2 300 000 2.375% Citigroup Inc 22/05/2024                                    | 2 264 557        | 0,13              |
| 1 600 000 2.250% CaixaBank SA 17/04/2030  | 1 485 792        | 0,08              | 2 200 000 1.750% Citigroup Inc 28/01/2025                                    | 2 129 710        | 0,12              |
| 1 820 000 0.375% Canadian Imperial Bank of Commerce 03/05/2024                      | 1 752 806        | 0,10              | 3 617 000 1.250% Citigroup Inc 06/07/2026                                    | 3 390 684        | 0,19              |
| 1 800 000 2.500% Capgemini SE 01/07/2023  | 1 795 508        | 0,10              | 2 800 000 1.500% Citigroup Inc 24/07/2026                                    | 2 633 708        | 0,15              |
| 700 000 1.000% Capgemini SE 18/10/2024  | 673 253          | 0,04              | 300 000 2.500% Citycon Treasury BV 01/10/2024                                | 286 020          | 0,02              |
| 1 300 000 0.625% Capgemini SE 23/06/2025  | 1 220 037        | 0,07              | 1 300 000 1.250% CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd 13/04/2025               | 1 231 620        | 0,07              |
| 1 200 000 0.800% Capital One Financial Corp 12/06/2024                              | 1 126 560        | 0,06              | 1 500 000 0.875% CK Hutchison Finance 16 II Ltd 03/10/2024                   | 1 431 450        | 0,08              |
| 600 000 0.500% Carlsberg Breweries AS 06/09/2023                                    | 592 398          | 0,03              | 2 250 000 1.250% CK Hutchison Finance 16 Ltd 06/04/2023                      | 2 249 662        | 0,13              |
| 2 144 000 2.500% Carlsberg Breweries AS 28/05/2024                                  | 2 115 849        | 0,12              | 2 745 000 0.375% CK Hutchison Group Telecom Finance SA 17/10/2023            | 2 699 378        | 0,15              |
| 700 000 3.250% Carlsberg Breweries AS 12/10/2025                                    | 696 234          | 0,04              | 1 200 000 0.000% Clearstream Banking AG 01/12/2025                           | 1 098 012        | 0,06              |
| 700 000 2.375% Carmila SA 18/09/2023  | 691 810          | 0,04              | 1 000 000 1.750% Cloverie PLC for Zurich Insurance Co Ltd 16/09/2024         | 969 440          | 0,05              |
| 800 000 2.375% Carmila SA 16/09/2024  | 778 248          | 0,04              | 600 000 2.875% CNH Industrial Finance Europe SA 17/05/2023                   | 599 628          | 0,03              |
| 700 000 0.107% Carrefour Banque SA 14/06/2025                                       | 646 240          | 0,04              | 1 950 000 0.000% CNH Industrial Finance Europe SA 01/04/2024                 | 1 882 058        | 0,11              |
| 1 000 000 0.875% Carrefour SA 12/06/2023  | 995 280          | 0,06              | 1 000 000 1.750% CNH Industrial Finance Europe SA 12/09/2025                 | 965 590          | 0,05              |
| 1 600 000 0.750% Carrefour SA 26/04/2024  | 1 554 704        | 0,09              | 1 000 000 4.250% CNP Assurances 05/06/2045                                   | 968 220          | 0,05              |
| 1 000 000 1.250% Carrefour SA 03/06/2025  | 950 900          | 0,05              | 800 000 4.000% CNP Assurances (Perpetual)                                    | 777 744          | 0,04              |
| 1 000 000 5.885% Cassa Centrale Banca - Credito Cooperativo Italiano SpA 16/02/2027 | 1 003 540        | 0,06              | 800 000 0.500% Coca-Cola Co 08/03/2024                                       | 779 656          | 0,04              |
| 800 000 2.125% Castellum AB 20/11/2023  | 778 976          | 0,04              | 600 000 2.625% Coca-Cola Europacific Partners PLC 06/11/2023                 | 597 372          | 0,03              |
| 900 000 2.000% Castellum Helsinki Finance Holding Abp 24/03/2025                    | 818 262          | 0,05              | 869 000 1.125% Coca-Cola Europacific Partners PLC 26/05/2024                 | 844 807          | 0,05              |
| 1 700 000 0.000% CCEP Finance Ireland DAC 06/09/2025                                | 1 557 812        | 0,09              | 600 000 2.375% Coca-Cola Europacific Partners PLC 07/05/2025                 | 587 352          | 0,03              |
| 700 000 1.125% Celanese US Holdings LLC 26/09/2023                                  | 692 055          | 0,04              | 1 000 000 1.750% Coca-Cola Europacific Partners PLC 27/03/2026               | 948 190          | 0,05              |
| 600 000 1.250% Celanese US Holdings LLC 11/02/2025                                  | 567 420          | 0,03              | 300 000 1.875% Coca-Cola HBC Finance BV 11/11/2024                           | 292 146          | 0,02              |
| 500 000 6.693% Ceska sporitelna AS 14/11/2025                                       | 510 320          | 0,03              |  |                  |                   |
| 1 300 000 1.000% Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd 12/12/2024              | 1 219 790        | 0,07              |  |                  |                   |
| 1 300 000 0.300% Chubb INA Holdings Inc 15/12/2024                                  | 1 225 744        | 0,07              |  |                  |                   |
| 1 600 000 1.750% Cie de Saint-Gobain 03/04/2023                                     | 1 600 000        | 0,09              |  |                  |                   |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR  | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets                              |           |      |
|---|---|-------------------|---|------------------|--|-----------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |   |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                  |  |           |      |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |   |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                  |  |           |      |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |   |                   | <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                  |  |           |      |
| 1 500 000   | 2.750% Coca-Cola HBC Finance BV<br>23/09/2025             | 1 480 260         | 0,08  | 1 600 000        | 4.000% Credit Agricole SA 12/10/2026           | 1 597 104 | 0,09 |
| 900 000   | 0.500% Colgate-Palmolive Co<br>06/03/2026                 | 832 265           | 0,05  | 1 200 000        | 1.625% Credit Agricole SA 05/06/2030           | 1 115 916 | 0,06 |
| 2 135 000   | 0.500% Commerzbank AG 28/08/2023                          | 2 108 974         | 0,12  | 1 900 000        | 5.125% Credit Agricole SA/London<br>18/04/2023 | 1 901 425 | 0,11 |
| 2 121 000   | 0.500% Commerzbank AG 13/09/2023                          | 2 093 151         | 0,12  | 1 600 000        | 3.125% Credit Agricole SA/London<br>17/07/2023 | 1 598 864 | 0,09 |
| 700 000   | 1.250% Commerzbank AG 23/10/2023                          | 691 131           | 0,04  | 1 600 000        | 0.750% Credit Agricole SA/London<br>05/12/2023 | 1 571 616 | 0,09 |
| 800 000   | 1.125% Commerzbank AG 24/05/2024                          | 775 952           | 0,04  | 2 000 000        | 2.375% Credit Agricole SA/London<br>20/05/2024 | 1 970 580 | 0,11 |
| 1 650 000   | 0.625% Commerzbank AG 28/08/2024                          | 1 574 892         | 0,09  | 1 800 000        | 0.500% Credit Agricole SA/London<br>24/06/2024 | 1 730 376 | 0,10 |
| 800 000   | 0.250% Commerzbank AG 16/09/2024                          | 755 880           | 0,04  | 1 600 000        | 1.000% Credit Agricole SA/London<br>16/09/2024 | 1 535 456 | 0,09 |
| 1 300 000   | 0.100% Commerzbank AG 11/09/2025                          | 1 185 990         | 0,07  | 1 900 000        | 1.375% Credit Agricole SA/London<br>13/03/2025 | 1 819 066 | 0,10 |
| 1 000 000   | 1.125% Commerzbank AG 19/09/2025                          | 918 140           | 0,05  | 1 300 000        | 3.125% Credit Agricole SA/London<br>05/02/2026 | 1 281 644 | 0,07 |
| 2 200 000   | 1.000% Commerzbank AG 04/03/2026                          | 2 032 234         | 0,11  | 900 000          | 1.350% Credit Logement SA 28/11/2029           | 835 506   | 0,05 |
| 700 000   | 0.750% Commerzbank AG 24/03/2026                          | 644 224           | 0,04  | 900 000          | 0.875% Credit Mutuel Arkea SA<br>05/10/2023    | 888 759   | 0,05 |
| 1 800 000   | 1.936% Commonwealth Bank of<br>Australia 03/10/2029       | 1 720 404         | 0,10  | 1 100 000        | 1.250% Credit Mutuel Arkea SA<br>31/05/2024    | 1 066 351 | 0,06 |
| 1 300 000   | 0.625% Compass Group Finance<br>Netherlands BV 03/07/2024 | 1 255 943         | 0,07  | 1 200 000        | 1.375% Credit Mutuel Arkea SA<br>17/01/2025    | 1 146 936 | 0,06 |
| 1 550 000   | 2.125% Conti-Gummi Finance BV<br>27/11/2023               | 1 536 468         | 0,09  | 900 000          | 0.010% Credit Mutuel Arkea SA<br>28/01/2026    | 805 932   | 0,05 |
| 1 200 000   | 1.125% Conti-Gummi Finance BV<br>25/09/2024               | 1 156 656         | 0,06  | 900 000          | 1.875% Credit Mutuel Arkea SA<br>25/10/2029    | 854 667   | 0,05 |
| 751 000   | 0.000% Continental AG 12/09/2023                          | 739 375           | 0,04  | 2 000 000        | 1.000% Credit Suisse AG/London<br>07/06/2023   | 1 980 020 | 0,11 |
| 1 100 000   | 0.375% Continental AG 27/06/2025                          | 1 032 537         | 0,06  | 1 600 000        | 2.125% Credit Suisse AG/London<br>31/05/2024   | 1 545 168 | 0,09 |
| 2 200 000   | 2.375% Cooperatieve Rabobank UA<br>22/05/2023             | 2 197 844         | 0,12  | 700 000          | 0.450% Credit Suisse AG/London<br>19/05/2025   | 633 500   | 0,04 |
| 600 000   | 3.875% Cooperatieve Rabobank UA<br>25/07/2023             | 599 976           | 0,03  | 2 300 000        | 0.250% Credit Suisse AG/London<br>05/01/2026   | 2 042 492 | 0,11 |
| 2 100 000   | 0.750% Cooperatieve Rabobank UA<br>29/08/2023             | 2 078 433         | 0,12  | 2 710 000        | 1.250% Credit Suisse Group AG<br>17/07/2025    | 2 536 067 | 0,14 |
| 2 200 000   | 0.625% Cooperatieve Rabobank UA<br>27/02/2024             | 2 139 830         | 0,12  | 3 500 000        | 3.250% Credit Suisse Group AG<br>02/04/2026    | 3 308 060 | 0,19 |
| 5 050 000   | 4.125% Cooperatieve Rabobank UA<br>14/07/2025             | 5 103 732         | 0,29  | 3 200 000        | 2.125% Credit Suisse Group AG<br>13/10/2026    | 2 915 968 | 0,16 |
| 3 500 000   | 1.250% Cooperatieve Rabobank UA<br>23/03/2026             | 3 291 986         | 0,18  | 600 000          | 5.375% Crelan SA 31/10/2025                    | 597 294   | 0,03 |
| 600 000   | 1.750% Covestro AG 25/09/2024                             | 585 456           | 0,03  | 1 167 000        | 3.125% CRH Finance DAC 03/04/2023              | 1 167 000 | 0,07 |
| 100 000   | 0.875% Covestro AG 03/02/2026                             | 93 621            | 0,01  | 900 000          | 0.875% CRH Finland Services Oyj<br>05/11/2023  | 886 689   | 0,05 |
| 1 000 000   | 1.625% Covivio 17/10/2024                                 | 966 400           | 0,05  | 1 150 000        | 1.875% CRH Funding BV 09/01/2024               | 1 134 947 | 0,06 |
| 700 000   | 1.875% Covivio Hotels SACA<br>24/09/2025                  | 635 180           | 0,04  | 1 200 000        | 1.500% Criteria Caixa SA 10/05/2023            | 1 198 008 | 0,07 |
| 1 500 000   | 4.500% Credit Agricole Assurances SA<br>(Perpetual)       | 1 462 950         | 0,08  | 1 200 000        | 1.375% Criteria Caixa SA 10/04/2024            | 1 169 772 | 0,07 |
| 1 600 000   | 4.250% Credit Agricole Assurances SA<br>(Perpetual)       | 1 562 816         | 0,09  |                  |  |           |      |
| 2 900 000   | 1.000% Credit Agricole SA 18/09/2025                      | 2 731 278         | 0,15  |                  |  |           |      |
| 1 700 000   | 0.375% Credit Agricole SA 21/10/2025                      | 1 569 168         | 0,09  |                  |  |           |      |
| 2 700 000   | 1.000% Credit Agricole SA 22/04/2026                      | 2 536 353         | 0,14  |                  |  |           |      |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets | Participation Investissement   | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|--|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                     |                         | <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>        |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                     |                         | <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>  |                     |                         |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                     |                         | <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>  |                     |                         |
| 700 000 2.125% Cromwell Ereit Lux Finco Sarl<br>19/11/2025              | 593 005             | 0,03                    | 2 100 000 0.750% Deutsche Bank AG 17/02/2027                             | 1 823 556           | 0,10                    |
| 750 000 0.625% CTP NV 27/11/2023  | 725 768             | 0,04                    | 800 000 1.625% Deutsche Boerse AG<br>08/10/2025                          | 779 144             | 0,04                    |
| 1 400 000 0.500% CTP NV 21/06/2025                                      | 1 228 402           | 0,07                    | 300 000 0.000% Deutsche Boerse AG<br>22/02/2026                          | 273 558             | 0,02                    |
| 600 000 2.125% CTP NV 01/10/2025  | 535 242             | 0,03                    | 900 000 0.125% Deutsche Pfandbriefbank AG<br>05/09/2024                  | 834 903             | 0,05                    |
| 300 000 0.875% CTP NV 20/01/2026  | 250 218             | 0,01                    | 1 300 000 0.250% Deutsche Pfandbriefbank AG<br>17/01/2025                | 1 180 972           | 0,07                    |
| 1 200 000 1.250% Daimler Truck International<br>Finance BV 06/04/2025   | 1 146 768           | 0,06                    | 1 600 000 0.250% Deutsche Pfandbriefbank AG<br>27/10/2025                | 1 398 432           | 0,08                    |
| 1 600 000 1.700% Danaher Corp 30/03/2024                                | 1 573 024           | 0,09                    | 400 000 0.100% Deutsche Pfandbriefbank AG<br>02/02/2026                  | 338 696             | 0,02                    |
| 800 000 4.375% Danica Pension Livsforsikrings<br>AB 29/09/2045          | 767 376             | 0,04                    | 800 000 2.750% Deutsche Post AG 09/10/2023                               | 797 616             | 0,04                    |
| 1 100 000 2.600% Danone SA 28/06/2023                                   | 1 098 240           | 0,06                    | 1 200 000 2.875% Deutsche Post AG 11/12/2024                             | 1 196 808           | 0,07                    |
| 1 300 000 1.250% Danone SA 30/05/2024                                   | 1 272 895           | 0,07                    | 700 000 0.875% Deutsche Telekom AG<br>25/03/2026                         | 657 110             | 0,04                    |
| 2 000 000 0.709% Danone SA 03/11/2024                                   | 1 928 400           | 0,11                    | 1 400 000 0.875% Deutsche Telekom International<br>Finance BV 30/01/2024 | 1 374 534           | 0,08                    |
| 1 300 000 1.125% Danone SA 14/01/2025                                   | 1 252 693           | 0,07                    | 1 000 000 2.750% Deutsche Telekom International<br>Finance BV 24/10/2024 | 994 450             | 0,06                    |
| 500 000 1.000% Danone SA 26/03/2025                                     | 480 420             | 0,03                    | 700 000 0.625% Deutsche Telekom International<br>Finance BV 13/12/2024   | 668 209             | 0,04                    |
| 1 800 000 0.000% Danone SA 01/12/2025                                   | 1 653 624           | 0,09                    | 700 000 4.875% Deutsche Telekom International<br>Finance BV 22/04/2025   | 724 535             | 0,04                    |
| 1 400 000 1.750% Danone SA (Perpetual)                                  | 1 389 192           | 0,08                    | 1 500 000 1.375% Deutsche Telekom International<br>Finance BV 01/12/2025 | 1 440 855           | 0,08                    |
| 2 150 000 0.875% Danske Bank A/S 22/05/2023                             | 2 143 743           | 0,12                    | 1 000 000 1.000% Deutsche Wohnen SE<br>30/04/2025                        | 934 860             | 0,05                    |
| 400 000 0.750% Danske Bank A/S 02/06/2023                               | 398 396             | 0,02                    | 2 200 000 0.200% DH Europe Finance II Sarl<br>18/03/2026                 | 2 013 528           | 0,11                    |
| 1 100 000 1.625% Danske Bank A/S 15/03/2024                             | 1 076 856           | 0,06                    | 447 000 0.125% Diageo Finance PLC<br>12/10/2023                          | 440 311             | 0,02                    |
| 2 900 000 0.010% Danske Bank A/S 10/11/2024                             | 2 835 243           | 0,16                    | 900 000 0.500% Diageo Finance PLC<br>19/06/2024                          | 869 778             | 0,05                    |
| 1 800 000 0.625% Danske Bank A/S 26/05/2025                             | 1 681 902           | 0,09                    | 800 000 1.750% Diageo Finance PLC<br>23/09/2024                          | 782 888             | 0,04                    |
| 1 800 000 0.500% Danske Bank A/S 27/08/2025                             | 1 705 122           | 0,10                    | 1 100 000 1.000% Diageo Finance PLC<br>22/04/2025                        | 1 049 301           | 0,06                    |
| 2 000 000 4.000% Danske Bank A/S 12/01/2027                             | 1 997 480           | 0,11                    | 700 000 0.625% Digital Dutch Finco BV<br>15/07/2025                      | 636 559             | 0,04                    |
| 1 300 000 1.375% Danske Bank A/S 17/02/2027                             | 1 191 151           | 0,07                    | 1 700 000 2.625% Digital Euro Finco LLC<br>15/04/2024                    | 1 660 348           | 0,09                    |
| 1 360 000 2.500% Danske Bank A/S 21/06/2029                             | 1 311 781           | 0,07                    | 1 600 000 2.500% Digital Euro Finco LLC<br>16/01/2026                    | 1 493 760           | 0,09                    |
| 1 300 000 1.375% Danske Bank A/S 12/02/2030                             | 1 203 982           | 0,07                    | 1 525 000 0.600% DNB Bank ASA 25/09/2023                                 | 1 505 465           | 0,08                    |
| 900 000 1.500% Danske Bank A/S 02/09/2030                               | 819 045             | 0,05                    | 3 691 000 0.050% DNB Bank ASA 14/11/2023                                 | 3 613 932           | 0,20                    |
| 1 000 000 0.000% Dassault Systemes SE<br>16/09/2024                     | 951 700             | 0,05                    | 1 300 000 0.250% DNB Bank ASA 09/04/2024                                 | 1 254 786           | 0,07                    |
| 1 159 000 1.500% DBS Group Holdings Ltd<br>11/04/2028                   | 1 156 659           | 0,06                    | 900 000 1.625% DNB Bank ASA 31/05/2026                                   | 858 816             | 0,05                    |
| 900 000 0.750% de Volksbank NV 25/06/2023                               | 894 762             | 0,05                    | 1 700 000 3.625% DNB Bank ASA 16/02/2027                                 | 1 686 247           | 0,09                    |
| 700 000 0.010% de Volksbank NV 16/09/2024                               | 662 683             | 0,04                    |  |                     |                         |
| 800 000 1.750% de Volksbank NV 22/10/2030                               | 728 880             | 0,04                    |  |                     |                         |
| 900 000 1.625% Dell Bank International DAC<br>24/06/2024                | 874 926             | 0,05                    |  |                     |                         |
| 1 450 000 1.125% Deutsche Bank AG 30/08/2023                            | 1 435 616           | 0,08                    |  |                     |                         |
| 2 000 000 2.750% Deutsche Bank AG 17/02/2025                            | 1 887 940           | 0,11                    |  |                     |                         |
| 900 000 1.125% Deutsche Bank AG 17/03/2025                              | 834 273             | 0,05                    |  |                     |                         |
| 2 600 000 1.000% Deutsche Bank AG 19/11/2025                            | 2 402 478           | 0,13                    |  |                     |                         |
| 1 400 000 2.625% Deutsche Bank AG 12/02/2026                            | 1 297 198           | 0,07                    |  |                     |                         |
| 800 000 1.375% Deutsche Bank AG 10/06/2026                              | 750 464             | 0,04                    |  |                     |                         |
| 2 900 000 1.375% Deutsche Bank AG 03/09/2026                            | 2 597 327           | 0,15                    |  |                     |                         |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>                           |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>                     |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 1 900 000 1.375% DS Smith PLC 26/07/2024  | 1 823 563        | 0,10              | 1 400 000 2.600% ELM BV for Swiss Reinsurance Co Ltd (Perpetual)        | 1 274 658        | 0,07              |
| 1 200 000 1.750% DXC Technology Co 15/01/2026   | 1 109 220        | 0,06              | 300 000 2.250% ELO SACA 06/04/2023                                      | 299 790          | 0,02              |
| 900 000 1.250% DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank Frankfurt Am Main 16/06/2023 | 896 634          | 0,05              | 1 300 000 2.625% ELO SACA 30/01/2024                                    | 1 281 995        | 0,07              |
| 1 440 000 3.000% E.ON International Finance BV 17/01/2024                                   | 1 439 942        | 0,08              | 1 200 000 2.375% ELO SACA 25/04/2025                                    | 1 155 384        | 0,06              |
| 1 500 000 1.000% E.ON International Finance BV 13/04/2025                                   | 1 429 395        | 0,08              | 1 400 000 2.875% ELO SACA 29/01/2026                                    | 1 324 470        | 0,07              |
| 1 150 000 0.375% E.ON SE 20/04/2023   | 1 148 011        | 0,06              | 900 000 0.375% Emerson Electric Co 22/05/2024                           | 869 382          | 0,05              |
| 1 297 000 0.000% E.ON SE 18/12/2023   | 1 267 973        | 0,07              | 800 000 1.250% Emerson Electric Co 15/10/2025                           | 757 400          | 0,04              |
| 600 000 0.875% E.ON SE 22/05/2024   | 582 144          | 0,03              | 1 000 000 1.250% Enagas Financiaciones SA 06/02/2025                    | 958 130          | 0,05              |
| 1 500 000 0.000% E.ON SE 28/08/2024   | 1 428 645        | 0,08              | 530 000 5.250% Enel Finance International NV 29/09/2023                 | 534 399          | 0,03              |
| 1 800 000 0.875% E.ON SE 08/01/2025   | 1 720 494        | 0,10              | 1 924 000 0.000% Enel Finance International NV 17/06/2024               | 1 845 462        | 0,10              |
| 1 300 000 1.000% E.ON SE 07/10/2025   | 1 229 384        | 0,07              | 2 200 000 1.000% Enel Finance International NV 16/09/2024               | 2 124 408        | 0,12              |
| 1 000 000 0.125% E.ON SE 18/01/2026   | 914 260          | 0,05              | 2 100 000 1.966% Enel Finance International NV 27/01/2025               | 2 045 925        | 0,11              |
| 1 600 000 2.614% East Japan Railway Co 08/09/2025   | 1 570 800        | 0,09              | 1 769 000 1.500% Enel Finance International NV 21/07/2025               | 1 696 966        | 0,10              |
| 1 630 000 1.500% Eastman Chemical Co 26/05/2023   | 1 624 523        | 0,09              | 2 200 000 0.250% Enel Finance International NV 17/11/2025               | 2 026 794        | 0,11              |
| 1 150 000 1.125% easyJet PLC 18/10/2023   | 1 134 211        | 0,06              | 1 800 000 5.250% Enel SpA 20/05/2024                                    | 1 833 030        | 0,10              |
| 1 300 000 0.875% easyJet PLC 11/06/2025   | 1 219 114        | 0,07              | 1 700 000 3.500% Enel SpA 24/05/2080                                    | 1 617 040        | 0,09              |
| 800 000 0.750% Eaton Capital UnLtd Co 20/09/2024  | 769 136          | 0,04              | 1 702 000 5.750% Engie Alliance GIE 24/06/2023                          | 1 708 774        | 0,10              |
| 1 050 000 0.697% Eaton Capital UnLtd Co 14/05/2025  | 987 441          | 0,06              | 900 000 0.875% Engie SA 27/03/2024                                      | 877 266          | 0,05              |
| 1 600 000 0.128% Eaton Capital UnLtd Co 08/03/2026  | 1 448 944        | 0,08              | 2 200 000 1.375% Engie SA 27/03/2025                                    | 2 112 770        | 0,12              |
| 900 000 1.000% Ecolab Inc 15/01/2024  | 883 080          | 0,05              | 600 000 0.875% Engie SA 19/09/2025                                      | 563 460          | 0,03              |
| 1 000 000 2.625% Ecolab Inc 08/07/2025  | 976 720          | 0,05              | 1 300 000 1.000% Engie SA 13/03/2026                                    | 1 213 732        | 0,07              |
| 900 000 1.375% Edenred 10/03/2025   | 865 008          | 0,05              | 200 000 3.875% Engie SA (Perpetual)                                     | 197 464          | 0,01              |
| 900 000 1.875% Edenred 06/03/2026   | 863 451          | 0,05              | 900 000 1.625% Engie SA (Perpetual)                                     | 828 378          | 0,05              |
| 1 100 000 2.375% EDP - Energias de Portugal SA 27/11/2023                                   | 1 092 410        | 0,06              | 1 200 000 3.250% Engie SA (Perpetual)                                   | 1 159 740        | 0,06              |
| 800 000 1.875% EDP Finance BV 29/09/2023  | 794 512          | 0,04              | 2 050 000 3.250% Eni SpA 10/07/2023                                     | 2 050 184        | 0,11              |
| 900 000 1.125% EDP Finance BV 12/02/2024  | 882 792          | 0,05              | 1 300 000 1.750% Eni SpA 18/01/2024                                     | 1 283 022        | 0,07              |
| 1 800 000 2.000% EDP Finance BV 22/04/2025  | 1 756 206        | 0,10              | 1 600 000 0.625% Eni SpA 19/09/2024                                     | 1 538 736        | 0,09              |
| 1 400 000 1.875% EDP Finance BV 13/10/2025  | 1 346 828        | 0,08              | 1 500 000 1.000% Eni SpA 14/03/2025                                     | 1 432 740        | 0,08              |
| 1 300 000 1.625% EDP Finance BV 26/01/2026  | 1 242 423        | 0,07              | 1 600 000 3.750% Eni SpA 12/09/2025                                     | 1 609 264        | 0,09              |
| 300 000 2.750% Elia Group SA/NV (Perpetual)   | 297 780          | 0,02              | 1 600 000 1.500% Eni SpA 02/02/2026                                     | 1 514 512        | 0,08              |
| 200 000 1.375% Elia Transmission Belgium SA 27/05/2024                                      | 195 374          | 0,01              | 2 500 000 2.625% Eni SpA (Perpetual)                                    | 2 303 775        | 0,13              |
| 1 700 000 1.375% Elia Transmission Belgium SA 14/01/2026                                    | 1 607 894        | 0,09              | 1 300 000 1.659% EP Infrastructure AS 26/04/2024                        | 1 219 257        | 0,07              |
| 750 000 0.875% Elisa Oyj 17/03/2024   | 730 208          | 0,04              | 700 000 1.875% ERG SpA 11/04/2025                                       | 674 527          | 0,04              |
| 200 000 1.125% Elisa Oyj 26/02/2026   | 184 702          | 0,01              | 200 000 1.250% Erste Bank Hungary Zrt 04/02/2026                        | 180 508          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 800 000 0.375% Erste Group Bank AG 16/04/2024                           | 773 192          | 0,04              |
| 800 000 0.050% Erste Group Bank AG 16/09/2025                           | 732 104          | 0,04              |
| 700 000 1.000% Erste Group Bank AG 10/06/2030                           | 628 222          | 0,04              |
| 1 700 000 0.000% EssilorLuxottica SA 27/05/2023                         | 1 692 486        | 0,09              |
| 1 000 000 0.250% EssilorLuxottica SA 05/01/2024                         | 976 430          | 0,05              |
| 900 000 2.625% EssilorLuxottica SA 10/02/2024                           | 895 914          | 0,05              |
| 300 000 2.375% EssilorLuxottica SA 09/04/2024                           | 296 721          | 0,02              |
| 2 600 000 0.125% EssilorLuxottica SA 27/05/2025                         | 2 426 762        | 0,14              |
| 2 300 000 0.375% EssilorLuxottica SA 05/01/2026                         | 2 133 595        | 0,12              |
| 800 000 2.500% Essity AB 09/06/2023                                     | 798 976          | 0,04              |
| 1 800 000 1.125% Essity AB 27/03/2024                                   | 1 756 998        | 0,10              |
| 300 000 5.000% Ethias SA 14/01/2026                                     | 294 801          | 0,02              |
| 800 000 0.500% Euroclear Bank SA 10/07/2023                             | 793 832          | 0,04              |
| 1 300 000 0.125% Euroclear Bank SA 07/07/2025                           | 1 210 092        | 0,07              |
| 800 000 2.125% Eurofins Scientific SE 25/07/2024                        | 780 512          | 0,04              |
| 1 500 000 1.625% Eurogrid GmbH 03/11/2023                               | 1 485 555        | 0,08              |
| 800 000 1.875% Eurogrid GmbH 10/06/2025                                 | 773 376          | 0,04              |
| 1 200 000 1.000% Euronext NV 18/04/2025                                 | 1 131 876        | 0,06              |
| 1 000 000 2.000% Eutelsat SA 02/10/2025                                 | 914 520          | 0,05              |
| 1 200 000 0.375% Evonik Industries AG 07/09/2024                        | 1 147 308        | 0,06              |
| 1 000 000 0.625% Evonik Industries AG 18/09/2025                        | 928 070          | 0,05              |
| 800 000 2.500% EXOR NV 08/10/2024                                       | 785 584          | 0,04              |
| 2 730 000 0.142% Exxon Mobil Corp 26/06/2024                            | 2 624 049        | 0,15              |
| 1 400 000 0.500% FCA Bank SpA/Ireland 18/09/2023                        | 1 382 388        | 0,08              |
| 1 845 000 0.125% FCA Bank SpA/Ireland 16/11/2023                        | 1 808 487        | 0,10              |
| 500 000 4.250% FCA Bank SpA/Ireland 24/03/2024                          | 501 715          | 0,03              |
| 1 300 000 0.000% FCA Bank SpA/Ireland 16/04/2024                        | 1 249 183        | 0,07              |
| 1 700 000 0.500% FCA Bank SpA/Ireland 13/09/2024                        | 1 615 221        | 0,09              |
| 1 200 000 0.815% FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU 04/12/2023    | 1 177 272        | 0,07              |
| 823 000 1.615% FCE Bank PLC 11/05/2023                                  | 820 045          | 0,05              |
| 900 000 0.450% FedEx Corp 05/08/2025                                    | 840 015          | 0,05              |
| 800 000 2.500% Ferrovial Emisiones SA 15/07/2024                        | 787 760          | 0,04              |
| 700 000 1.375% Ferrovial Emisiones SA 31/03/2025                        | 669 375          | 0,04              |

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 2 500 000 0.750% Fidelity National Information Services Inc 21/05/2023  | 2 491 675        | 0,14              |
| 1 100 000 1.100% Fidelity National Information Services Inc 15/07/2024  | 1 064 052        | 0,06              |
| 1 100 000 0.625% Fidelity National Information Services Inc 03/12/2025  | 1 012 275        | 0,06              |
| 1 000 000 0.375% Fiserv Inc 01/07/2023                                  | 992 670          | 0,06              |
| 600 000 1.375% Floene Energias SA 19/09/2023                            | 593 370          | 0,03              |
| 800 000 0.750% Fonterra Co-operative Group Ltd 08/11/2024               | 754 568          | 0,04              |
| 1 214 000 1.500% Fresenius Finance Ireland PLC 30/01/2024               | 1 191 832        | 0,07              |
| 800 000 0.000% Fresenius Finance Ireland PLC 01/10/2025                 | 729 240          | 0,04              |
| 945 000 0.250% Fresenius Medical Care AG & Co KGaA 29/11/2023           | 924 390          | 0,05              |
| 700 000 1.500% Fresenius Medical Care AG & Co KGaA 11/07/2025           | 669 158          | 0,04              |
| 500 000 4.000% Fresenius SE & Co KGaA 01/02/2024                        | 501 055          | 0,03              |
| 800 000 1.875% Fresenius SE & Co KGaA 15/02/2025                        | 779 472          | 0,04              |
| 1 300 000 1.875% Fresenius SE & Co KGaA 24/05/2025                      | 1 253 148        | 0,07              |
| 700 000 1.500% Gecina SA 20/01/2025                                     | 671 895          | 0,04              |
| 600 000 1.250% General Electric Co 26/05/2023                           | 597 390          | 0,03              |
| 1 400 000 0.875% General Electric Co 17/05/2025                         | 1 322 762        | 0,07              |
| 900 000 1.000% General Mills Inc 27/04/2023                             | 898 722          | 0,05              |
| 800 000 0.125% General Mills Inc 15/11/2025                             | 733 696          | 0,04              |
| 1 100 000 0.450% General Mills Inc 15/01/2026                           | 1 009 822        | 0,06              |
| 1 000 000 0.955% General Motors Financial Co Inc 07/09/2023             | 988 760          | 0,06              |
| 1 400 000 2.200% General Motors Financial Co Inc 01/04/2024             | 1 379 014        | 0,08              |
| 1 300 000 1.000% General Motors Financial Co Inc 24/02/2025             | 1 232 062        | 0,07              |
| 1 500 000 1.694% General Motors Financial Co Inc 26/03/2025             | 1 437 750        | 0,08              |
| 400 000 0.850% General Motors Financial Co Inc 26/02/2026               | 363 888          | 0,02              |
| 1 358 000 0.125% GlaxoSmithKline Capital PLC 12/05/2023                 | 1 353 912        | 0,08              |
| 600 000 0.000% GlaxoSmithKline Capital PLC 23/09/2023                   | 590 694          | 0,03              |
| 1 700 000 1.375% GlaxoSmithKline Capital PLC 02/12/2024                 | 1 651 975        | 0,09              |
| 1 300 000 4.000% GlaxoSmithKline Capital PLC 16/06/2025                 | 1 320 761        | 0,07              |
| 2 009 000 1.875% Glencore Finance Europe Ltd 13/09/2023                 | 1 994 234        | 0,11              |



## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR  | % des<br>actifs<br>nets | Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets   |           |      |
|---|--|-------------------------|---|---------------------|---|-----------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |  |                         | <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                     |   |           |      |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |  |                         | <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                     |   |           |      |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |  |                         | <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                     |   |           |      |
| 1 400 000   | 0.625% Glencore Finance Europe Ltd<br>11/09/2024             | 1 337 574               | 0,07  | 1 038 000           | 3.875% Harley-Davidson Financial<br>Services Inc 19/05/2023                   | 1 036 962 | 0,06 |
| 1 200 000   | 1.750% Glencore Finance Europe Ltd<br>17/03/2025             | 1 150 752               | 0,06  | 1 100 000           | 0.900% Harley-Davidson Financial<br>Services Inc 19/11/2024                   | 1 048 168 | 0,06 |
| 1 096 000   | 1.500% Global Switch Holdings Ltd<br>31/01/2024              | 1 072 513               | 0,06  | 1 000 000           | 5.125% Harley-Davidson Financial<br>Services Inc 05/04/2026                   | 1 006 250 | 0,06 |
| 1 000 000   | 3.000% Globalworth Real Estate<br>Investments Ltd 29/03/2025 | 869 290                 | 0,05  | 700 000             | 4.500% HBOS PLC 18/03/2030  | 680 442   | 0,04 |
| 2 445 000   | 2.000% Goldman Sachs Group Inc<br>27/07/2023                 | 2 434 829               | 0,14  | 1 100 000           | 1.500% Heathrow Funding Ltd<br>12/10/2027                                     | 1 037 949 | 0,06 |
| 3 595 000   | 0.010% Goldman Sachs Group Inc<br>30/04/2024                 | 3 585 437               | 0,20  | 1 200 000           | 2.250% HeidelbergCement AG<br>03/06/2024                                      | 1 181 028 | 0,07 |
| 3 650 000   | 1.375% Goldman Sachs Group Inc<br>15/05/2024                 | 3 559 334               | 0,20  | 1 840 000           | 1.500% HeidelbergCement AG<br>07/02/2025                                      | 1 763 088 | 0,10 |
| 1 600 000   | 0.125% Goldman Sachs Group Inc<br>19/08/2024                 | 1 525 440               | 0,09  | 1 300 000           | 2.500% HeidelbergCement Finance<br>Luxembourg SA 09/10/2024                   | 1 276 613 | 0,07 |
| 1 540 000   | 2.125% Goldman Sachs Group Inc<br>30/09/2024                 | 1 506 982               | 0,08  | 420 000             | 2.125% Heimstaden Bostad AB<br>05/09/2023                                     | 412 583   | 0,02 |
| 3 500 000   | 3.375% Goldman Sachs Group Inc<br>27/03/2025                 | 3 476 480               | 0,19  | 600 000             | 1.125% Heimstaden Bostad AB<br>21/01/2026                                     | 504 624   | 0,03 |
| 2 900 000   | 1.250% Goldman Sachs Group Inc<br>01/05/2025                 | 2 754 536               | 0,15  | 2 200 000           | 0.250% Heimstaden Bostad Treasury<br>BV 13/10/2024                            | 1 989 130 | 0,11 |
| 900 000   | 1.375% Goodman Australia Finance Pty<br>Ltd 27/09/2025       | 824 373                 | 0,05  | 1 250 000           | 0.625% Heimstaden Bostad Treasury<br>BV 24/07/2025                            | 1 068 525 | 0,06 |
| 800 000   | 2.500% Grand City Properties SA<br>(Perpetual)               | 349 216                 | 0,02  | 745 000             | 3.500% Heineken NV 19/03/2024   | 745 089   | 0,04 |
| 800 000   | 2.500% Great-West Lifeco Inc<br>18/04/2023                   | 799 784                 | 0,04  | 900 000             | 3.875% Heineken NV 23/09/2024   | 904 617   | 0,05 |
| 1 000 000   | 1.625% Grenke Finance PLC<br>05/04/2024                      | 962 370                 | 0,05  | 800 000             | 1.500% Heineken NV 07/12/2024   | 772 544   | 0,04 |
| 800 000   | 0.625% Grenke Finance PLC<br>09/01/2025                      | 711 960                 | 0,04  | 1 000 000           | 1.625% Heineken NV 30/03/2025   | 966 490   | 0,05 |
| 800 000   | 3.950% Grenke Finance PLC<br>09/07/2025                      | 762 280                 | 0,04  | 1 200 000           | 2.875% Heineken NV 04/08/2025   | 1 189 188 | 0,07 |
| 1 300 000   | 1.375% Groupe Bruxelles Lambert NV<br>23/05/2024             | 1 268 748               | 0,07  | 550 000             | 1.000% Hella GmbH & Co KGaA<br>17/05/2024                                     | 533 638   | 0,03 |
| 800 000   | 1.875% Groupe Bruxelles Lambert NV<br>19/06/2025             | 770 968                 | 0,04  | 900 000             | 0.000% Highland Holdings Sarl<br>12/11/2023                                   | 879 822   | 0,05 |
| 1 500 000   | 1.250% GSK Consumer Healthcare<br>Capital NL BV 29/03/2026   | 1 400 220               | 0,08  | 700 000             | 1.750% HOCHTIEF AG 03/07/2025   | 672 637   | 0,04 |
| 900 000   | 6.250% Hamburg Commercial Bank AG<br>18/11/2024              | 902 934                 | 0,05  | 1 291 000           | 1.375% Holcim Finance Luxembourg SA<br>26/05/2023                             | 1 287 540 | 0,07 |
| 1 300 000   | 4.875% Hamburg Commercial Bank AG<br>17/03/2025              | 1 299 220               | 0,07  | 700 000             | 3.000% Holcim Finance Luxembourg SA<br>22/01/2024                             | 698 894   | 0,04 |
| 500 000   | 0.375% Hamburg Commercial Bank AG<br>09/03/2026              | 438 740                 | 0,02  | 900 000             | 1.500% Holcim Finance Luxembourg SA<br>06/04/2025                             | 862 965   | 0,05 |
| 900 000   | 0.500% Hamburg Commercial Bank AG<br>22/09/2026              | 786 186                 | 0,04  | 800 000             | 2.375% Holcim Finance Luxembourg SA<br>09/04/2025                             | 784 784   | 0,04 |
| 1 100 000   | 5.000% Hannover Finance Luxembourg<br>SA 30/06/2043          | 1 096 358               | 0,06  | 1 200 000           | 3.000% Holcim Finance Luxembourg SA<br>(Perpetual)                            | 1 155 948 | 0,06 |
| 900 000   | 3.375% Hannover Rueck SE (Perpetual)                         | 855 504                 | 0,05  | 1 100 000           | 2.250% Holding d'Infrastructures de<br>Transport SASU 24/03/2025              | 1 066 626 | 0,06 |
|   |  |                         |   | 800 000             | 0.125% Holding d'Infrastructures des<br>Metiers de l'Environnement 16/09/2025 | 721 576   | 0,04 |
|   |  |                         |   | 1 281 000           | 0.000% Honeywell International Inc<br>10/03/2024                              | 1 238 958 | 0,07 |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR                                 | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets   |           |      |
|---|--|-------------------|---|------------------|---|-----------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                  |   |           |      |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                  |   |           |      |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |  |                   | <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                  |   |           |      |
| 1 800 000   | 0.250% HSBC Continental Europe SA<br>17/05/2024  | 1 728 756         | 0,10  | 1 700 000        | 0.100% ING Groep NV 03/09/2025                                | 1 604 103 | 0,09 |
| 3 400 000   | 0.875% HSBC Holdings PLC<br>06/09/2024           | 3 271 412         | 0,18  | 3 100 000        | 0.125% ING Groep NV 29/11/2025                                | 2 895 927 | 0,16 |
| 2 200 000   | 1.500% HSBC Holdings PLC<br>04/12/2024           | 2 167 440         | 0,12  | 1 500 000        | 2.125% ING Groep NV 10/01/2026                                | 1 440 570 | 0,08 |
| 2 450 000   | 3.000% HSBC Holdings PLC<br>30/06/2025           | 2 390 146         | 0,13  | 2 500 000        | 2.125% ING Groep NV 23/05/2026                                | 2 399 125 | 0,13 |
| 1 800 000   | 0.309% HSBC Holdings PLC<br>13/11/2026           | 1 637 874         | 0,09  | 2 600 000        | 1.250% ING Groep NV 16/02/2027                                | 2 383 290 | 0,13 |
| 700 000   | 3.750% Ibercaja Banco SA 15/06/2025              | 688 002           | 0,04  | 1 700 000        | 3.000% ING Groep NV 11/04/2028                                | 1 698 929 | 0,10 |
| 1 300 000   | 1.000% Iberdrola Finanzas SA<br>07/03/2024       | 1 273 402         | 0,07  | 1 300 000        | 2.500% ING Groep NV 15/02/2029                                | 1 268 085 | 0,07 |
| 1 800 000   | 1.000% Iberdrola Finanzas SA<br>07/03/2025       | 1 723 878         | 0,10  | 2 000 000        | 1.625% ING Groep NV 26/09/2029                                | 1 884 540 | 0,11 |
| 1 300 000   | 0.875% Iberdrola Finanzas SA<br>16/06/2025       | 1 232 777         | 0,07  | 1 500 000        | 2.000% ING Groep NV 22/03/2030                                | 1 401 945 | 0,08 |
| 1 100 000   | 1.750% Iberdrola International BV<br>17/09/2023  | 1 092 850         | 0,06  | 1 700 000        | 1.000% ING Groep NV 13/11/2030                                | 1 517 930 | 0,09 |
| 700 000   | 1.875% Iberdrola International BV<br>08/10/2024  | 686 469           | 0,04  | 900 000          | 1.625% Inmobiliaria Colonial Socimi SA<br>28/11/2025          | 848 997   | 0,05 |
| 1 000 000   | 0.375% Iberdrola International BV<br>15/09/2025  | 935 590           | 0,05  | 900 000          | 1.625% InterContinental Hotels Group<br>PLC 08/10/2024        | 869 652   | 0,05 |
| 2 100 000   | 1.875% Iberdrola International BV<br>(Perpetual) | 2 085 195         | 0,12  | 1 380 000        | 1.250% International Business<br>Machines Corp 26/05/2023     | 1 376 012 | 0,08 |
| 1 200 000   | 2.625% Iberdrola International BV<br>(Perpetual) | 1 175 952         | 0,07  | 1 450 000        | 1.125% International Business<br>Machines Corp 06/09/2024     | 1 405 499 | 0,08 |
| 1 400 000   | 3.250% Iberdrola International BV<br>(Perpetual) | 1 344 910         | 0,08  | 1 800 000        | 0.875% International Business<br>Machines Corp 31/01/2025     | 1 718 424 | 0,10 |
| 900 000   | 1.125% ICADE 17/11/2025                          | 839 619           | 0,05  | 1 800 000        | 0.950% International Business<br>Machines Corp 23/05/2025     | 1 710 036 | 0,10 |
| 800 000   | 1.250% Illinois Tool Works Inc<br>22/05/2023     | 797 960           | 0,04  | 2 100 000        | 2.875% International Business<br>Machines Corp 07/11/2025     | 2 073 981 | 0,12 |
| 900 000   | 0.250% Illinois Tool Works Inc<br>05/12/2024     | 852 921           | 0,05  | 700 000          | 2.375% International Distributions<br>Services PLC 29/07/2024 | 684 824   | 0,04 |
| 1 000 000   | 2.000% Imerys SA 10/12/2024                      | 968 140           | 0,05  | 900 000          | 1.750% International Flavors &<br>Fragrances Inc 14/03/2024   | 880 497   | 0,05 |
| 1 600 000   | 1.125% Imperial Brands Finance PLC<br>14/08/2023 | 1 585 216         | 0,09  | 1 900 000        | 2.125% Intesa Sanpaolo SpA<br>30/08/2023                      | 1 888 163 | 0,11 |
| 1 000 000   | 1.375% Imperial Brands Finance PLC<br>27/01/2025 | 956 690           | 0,05  | 1 650 000        | 4.000% Intesa Sanpaolo SpA<br>30/10/2023                      | 1 652 211 | 0,09 |
| 100 000   | 3.375% Imperial Brands Finance PLC<br>26/02/2026 | 97 814            | 0,01  | 2 245 000        | 1.375% Intesa Sanpaolo SpA<br>18/01/2024                      | 2 204 972 | 0,12 |
| 900 000   | 2.125% Indigo Group SAS 16/04/2025               | 870 750           | 0,05  | 1 300 000        | 1.500% Intesa Sanpaolo SpA<br>10/04/2024                      | 1 270 633 | 0,07 |
| 1 300 000   | 0.750% Infineon Technologies AG<br>24/06/2023    | 1 291 706         | 0,07  | 400 000          | 2.625% Intesa Sanpaolo SpA<br>20/06/2024                      | 393 420   | 0,02 |
| 1 200 000   | 0.625% Infineon Technologies AG<br>17/02/2025    | 1 136 052         | 0,06  | 2 400 000        | 1.000% Intesa Sanpaolo SpA<br>04/07/2024                      | 2 316 731 | 0,13 |
| 922 000   | 1.500% Informa PLC 05/07/2023                    | 917 123           | 0,05  | 1 350 000        | 0.750% Intesa Sanpaolo SpA<br>04/12/2024                      | 1 283 459 | 0,07 |
| 1 300 000   | 2.125% Informa PLC 06/10/2025                    | 1 239 173         | 0,07  | 250 000          | 1.625% Intesa Sanpaolo SpA<br>21/04/2025                      | 237 953   | 0,01 |
| 1 300 000   | 1.000% ING Groep NV 20/09/2023                   | 1 285 882         | 0,07  | 2 300 000        | 2.125% Intesa Sanpaolo SpA<br>26/05/2025                      | 2 214 670 | 0,12 |
| 1 800 000   | 1.125% ING Groep NV 14/02/2025                   | 1 715 760         | 0,10  | 1 650 000        | 0.625% Intesa Sanpaolo SpA<br>24/02/2026                      | 1 489 818 | 0,08 |
|   |  |                   |   | 600 000          | 1.250% Investec Bank PLC 11/08/2026                           | 525 546   | 0,03 |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets | Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                     |                         | <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                     |                         | <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                     |                         | <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 500 000 0.500% Investec Bank PLC 17/02/2027                             | 423 580             | 0,02                    | 1 300 000 0.125% KBC Group NV 10/09/2026                                | 1 182 974           | 0,07                    |
| 900 000 0.875% Iren SpA 04/11/2024                                      | 859 563             | 0,05                    | 800 000 0.250% KBC Group NV 01/03/2027                                  | 717 768             | 0,04                    |
| 1 000 000 1.950% Iren SpA 19/09/2025                                    | 953 190             | 0,05                    | 900 000 1.625% KBC Group NV 18/09/2029                                  | 856 413             | 0,05                    |
| 800 000 1.250% ISS Finance BV 07/07/2025                                | 753 320             | 0,04                    | 1 300 000 0.500% KBC Group NV 03/12/2029                                | 1 202 448           | 0,07                    |
| 500 000 2.125% ISS Global A/S 02/12/2024                                | 485 655             | 0,03                    | 1 100 000 1.000% Kellogg Co 17/05/2024                                  | 1 067 825           | 0,06                    |
| 700 000 1.125% Italgas SpA 14/03/2024                                   | 682 192             | 0,04                    | 1 000 000 1.250% Kellogg Co 10/03/2025                                  | 959 650             | 0,05                    |
| 900 000 0.250% Italgas SpA 24/06/2025                                   | 836 100             | 0,05                    | 600 000 0.250% Kering SA 13/05/2023                                     | 598 194             | 0,03                    |
| 1 000 000 1.750% JAB Holdings BV 25/05/2023                             | 996 940             | 0,06                    | 800 000 2.750% Kering SA 08/04/2024                                     | 799 128             | 0,04                    |
| 600 000 1.250% JAB Holdings BV 22/05/2024                               | 585 282             | 0,03                    | 1 700 000 1.250% Kering SA 05/05/2025                                   | 1 627 852           | 0,09                    |
| 1 600 000 1.625% JAB Holdings BV 30/04/2025                             | 1 538 176           | 0,09                    | 1 500 000 2.375% Kerry Group Financial Services<br>Unitd Co 10/09/2025  | 1 474 020           | 0,08                    |
| 1 100 000 1.000% JCDecaux SE 01/06/2023                                 | 1 095 325           | 0,06                    | 1 000 000 0.625% Kimberly-Clark Corp 07/09/2024                         | 961 860             | 0,05                    |
| 1 000 000 2.000% JCDecaux SE 24/10/2024                                 | 971 270             | 0,05                    | 600 000 1.625% KION Group AG 24/09/2025                                 | 549 786             | 0,03                    |
| 900 000 0.244% JDE Peet's NV 16/01/2025                                 | 841 050             | 0,05                    | 800 000 1.000% Klepierre SA 17/04/2023                                  | 798 992             | 0,04                    |
| 1 400 000 0.000% JDE Peet's NV 16/01/2026                               | 1 247 638           | 0,07                    | 300 000 1.750% Klepierre SA 06/11/2024                                  | 292 155             | 0,02                    |
| 1 100 000 1.000% Jefferies Financial Group Inc<br>19/07/2024            | 1 051 985           | 0,06                    | 1 200 000 1.875% Klepierre SA 19/02/2026                                | 1 135 992           | 0,06                    |
| 599 000 0.500% John Deere Cash Management<br>SARL 15/09/2023            | 591 578             | 0,03                    | 1 200 000 1.125% Knorr-Bremse AG 13/06/2025                             | 1 144 740           | 0,06                    |
| 1 500 000 1.375% John Deere Cash Management<br>SARL 02/04/2024          | 1 473 660           | 0,08                    | 600 000 1.500% Kojamo Oyj 19/06/2024                                    | 567 486             | 0,03                    |
| 1 360 000 0.650% Johnson & Johnson 20/05/2024                           | 1 322 546           | 0,07                    | 1 000 000 1.625% Kojamo Oyj 07/03/2025                                  | 914 390             | 0,05                    |
| 1 960 000 1.000% Johnson Controls International<br>plc 15/09/2023       | 1 939 165           | 0,11                    | 500 000 2.000% Kojamo Oyj 31/03/2026                                    | 443 690             | 0,02                    |
| 800 000 1.375% Johnson Controls International<br>plc 25/02/2025         | 768 568             | 0,04                    | 500 000 0.250% Kommunalkredit Austria AG<br>14/05/2024                  | 472 080             | 0,03                    |
| 4 525 000 0.625% JPMorgan Chase & Co<br>25/01/2024                      | 4 416 355           | 0,25                    | 1 300 000 0.875% Koninklijke Ahold Delhaize NV<br>19/09/2024            | 1 251 510           | 0,07                    |
| 2 000 000 1.500% JPMorgan Chase & Co<br>27/01/2025                      | 1 930 820           | 0,11                    | 1 100 000 0.250% Koninklijke Ahold Delhaize NV<br>26/06/2025            | 1 026 278           | 0,06                    |
| 1 100 000 3.000% JPMorgan Chase & Co<br>19/02/2026                      | 1 084 259           | 0,06                    | 900 000 1.125% Koninklijke Ahold Delhaize NV<br>19/03/2026              | 847 026             | 0,05                    |
| 3 500 000 1.090% JPMorgan Chase & Co<br>11/03/2027                      | 3 226 444           | 0,18                    | 800 000 2.375% Koninklijke DSM NV 03/04/2024                            | 793 624             | 0,04                    |
| 1 000 000 1.125% JT International Financial<br>Services BV 28/09/2025   | 933 580             | 0,05                    | 800 000 1.000% Koninklijke DSM NV 09/04/2025                            | 765 184             | 0,04                    |
| 900 000 0.625% Jyske Bank A/S 20/06/2024                                | 893 385             | 0,05                    | 700 000 5.625% Koninklijke KPN NV 30/09/2024                            | 721 413             | 0,04                    |
| 900 000 0.375% Jyske Bank A/S 15/10/2025                                | 848 529             | 0,05                    | 1 000 000 0.625% Koninklijke KPN NV 09/04/2025                          | 949 510             | 0,05                    |
| 900 000 4.625% Jyske Bank A/S 11/04/2026                                | 900 153             | 0,05                    | 500 000 1.375% Koninklijke Philips NV<br>30/03/2025                     | 477 485             | 0,03                    |
| 800 000 0.050% Jyske Bank A/S 02/09/2026                                | 722 968             | 0,04                    | 1 600 000 2.000% Kraft Heinz Foods Co<br>30/06/2023                     | 1 593 168           | 0,09                    |
| 400 000 2.250% Jyske Bank A/S 05/04/2029                                | 388 316             | 0,02                    | 1 000 000 1.500% Kraft Heinz Foods Co<br>24/05/2024                     | 979 910             | 0,05                    |
| 900 000 0.875% KBC Group NV 27/06/2023                                  | 895 212             | 0,05                    | 600 000 0.500% Kutxabank SA 25/09/2024                                  | 568 398             | 0,03                    |
| 1 300 000 0.750% KBC Group NV 18/10/2023                                | 1 281 358           | 0,07                    | 1 200 000 5.050% La Mondiale SAM (Perpetual)                            | 1 174 428           | 0,07                    |
| 2 300 000 1.125% KBC Group NV 25/01/2024                                | 2 253 977           | 0,13                    | 675 000 0.875% Lansforsakringar Bank AB<br>25/09/2023                   | 666 171             | 0,04                    |
| 800 000 0.625% KBC Group NV 10/04/2025                                  | 755 808             | 0,04                    | 1 100 000 0.125% Lansforsakringar Bank AB<br>19/02/2025                 | 1 024 507           | 0,06                    |
| 1 200 000 2.875% KBC Group NV 29/06/2025                                | 1 180 992           | 0,07                    | 800 000 1.125% LANXESS AG 16/05/2025                                    | 760 424             | 0,04                    |
| 1 600 000 1.500% KBC Group NV 29/03/2026                                | 1 519 904           | 0,09                    | 500 000 1.000% LeasePlan Corp NV 02/05/2023                             | 498 960             | 0,03                    |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|--|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>                |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>          |                     |                         |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>  |                     |                         |
| 1 600 000 0.125% LeasePlan Corp NV 13/09/2023                                    | 1 572 880           | 0,09                    |
| 1 239 000 1.375% LeasePlan Corp NV 07/03/2024                                    | 1 206 736           | 0,07                    |
| 800 000 3.500% LeasePlan Corp NV 09/04/2025                                      | 790 336             | 0,04                    |
| 1 600 000 2.125% LeasePlan Corp NV 06/05/2025                                    | 1 533 936           | 0,09                    |
| 1 700 000 0.250% LeasePlan Corp NV 23/02/2026                                    | 1 523 999           | 0,09                    |
| 1 500 000 0.000% Leasys SpA 22/07/2024   | 1 428 045           | 0,08                    |
| 500 000 4.375% Leasys SpA 07/12/2024   | 504 425             | 0,03                    |
| 900 000 1.250% LEG Immobilien SE 23/01/2024                                      | 872 019             | 0,05                    |
| 500 000 0.375% LEG Immobilien SE 17/01/2026                                      | 447 715             | 0,03                    |
| 600 000 0.500% Legrand SA 09/10/2023   | 590 106             | 0,03                    |
| 900 000 0.750% Legrand SA 06/07/2024   | 871 569             | 0,05                    |
| 700 000 1.000% Legrand SA 06/03/2026   | 657 916             | 0,04                    |
| 900 000 0.500% LG Chem Ltd 15/04/2023  | 898 569             | 0,05                    |
| 1 100 000 1.750% Liberty Mutual Finance Europe DAC 27/03/2024                    | 1 073 149           | 0,06                    |
| 1 150 000 2.000% Linde Finance BV 18/04/2023                                     | 1 149 448           | 0,06                    |
| 525 000 1.875% Linde Finance BV 22/05/2024                                       | 519 272             | 0,03                    |
| 1 700 000 1.200% Linde Inc/CT 12/02/2024   | 1 670 199           | 0,09                    |
| 900 000 1.625% Linde Inc/CT 01/12/2025   | 862 407             | 0,05                    |
| 800 000 3.875% LKQ Italia Bondco di LKQ Italia Bondco Gp SRL E C SAPA 01/04/2024 | 796 416             | 0,04                    |
| 1 500 000 0.375% Lloyds Bank Corporate Markets PLC 28/01/2025                    | 1 411 005           | 0,08                    |
| 1 500 000 1.250% Lloyds Bank PLC 13/01/2025                                      | 1 435 770           | 0,08                    |
| 300 000 1.000% Lloyds Banking Group PLC 09/11/2023                               | 295 503             | 0,02                    |
| 1 800 000 0.500% Lloyds Banking Group PLC 12/11/2025                             | 1 705 068           | 0,10                    |
| 2 600 000 3.500% Lloyds Banking Group PLC 01/04/2026                             | 2 570 074           | 0,14                    |
| 2 000 000 1.750% Lloyds Banking Group PLC 07/09/2028                             | 1 967 060           | 0,11                    |
| 700 000 4.500% Lloyds Banking Group PLC 18/03/2030                               | 683 942             | 0,04                    |
| 1 900 000 0.750% Logikor Financing Sarl 15/07/2024                               | 1 766 563           | 0,10                    |
| 1 250 000 2.250% Logikor Financing Sarl 13/05/2025                               | 1 144 030           | 0,06                    |
| 1 900 000 0.375% L'Oreal SA 29/03/2024   | 1 845 166           | 0,10                    |
| 1 200 000 2.375% Louis Dreyfus Co Finance BV 27/11/2025                          | 1 140 156           | 0,06                    |
| 1 100 000 0.000% Lseg Netherlands BV 06/04/2025                                  | 1 025 200           | 0,06                    |
| 300 000 5.000% Luminor Bank AS/Estonia 29/08/2024                                | 297 375             | 0,02                    |
| 750 000 0.792% Luminor Bank AS/Estonia 03/12/2024                                | 712 298             | 0,04                    |

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 500 000 7.250% Luminor Bank AS/Estonia 16/01/2026                       | 499 795             | 0,03                    |
| 600 000 0.539% Luminor Bank AS/Estonia 23/09/2026                       | 522 948             | 0,03                    |
| 3 000 000 0.000% LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 11/02/2024         | 2 920 410           | 0,16                    |
| 2 484 000 0.750% LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 26/05/2024         | 2 419 714           | 0,14                    |
| 2 700 000 0.750% LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 07/04/2025         | 2 566 971           | 0,14                    |
| 1 200 000 0.000% LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 11/02/2026         | 1 092 960           | 0,06                    |
| 700 000 1.250% Macquarie Group Ltd 05/03/2025                           | 681 289             | 0,04                    |
| 700 000 1.375% Madrilena Red de Gas Finance BV 11/04/2025               | 659 099             | 0,04                    |
| 1 000 000 1.900% Magna International Inc 24/11/2023                     | 989 120             | 0,06                    |
| 400 000 2.000% McDonald's Corp 01/06/2023                               | 399 260             | 0,02                    |
| 1 800 000 1.000% McDonald's Corp 15/11/2023                             | 1 774 638           | 0,10                    |
| 2 200 000 0.625% McDonald's Corp 29/01/2024                             | 2 152 150           | 0,12                    |
| 600 000 2.375% McDonald's Corp 27/11/2024                               | 590 382             | 0,03                    |
| 1 000 000 1.500% McKesson Corp 17/11/2025                               | 947 070             | 0,05                    |
| 1 100 000 1.625% Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 07/01/2025 | 1 056 847           | 0,06                    |
| 750 000 1.125% Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 23/04/2025   | 707 190             | 0,04                    |
| 800 000 1.125% Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 15/07/2025   | 752 696             | 0,04                    |
| 800 000 0.875% Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 15/01/2026   | 737 984             | 0,04                    |
| 1 700 000 0.250% Medtronic Global Holdings SCA 02/07/2025               | 1 586 049           | 0,09                    |
| 1 700 000 0.000% Medtronic Global Holdings SCA 15/10/2025               | 1 566 414           | 0,09                    |
| 900 000 2.625% Medtronic Global Holdings SCA 15/10/2025                 | 880 016             | 0,05                    |
| 300 000 1.400% Mercedes-Benz Group AG 12/01/2024                        | 295 857             | 0,02                    |
| 400 000 1.875% Mercedes-Benz Group AG 08/07/2024                        | 394 888             | 0,02                    |
| 1 016 000 0.750% Mercedes-Benz International Finance BV 11/05/2023      | 1 013 369           | 0,06                    |
| 1 700 000 1.625% Mercedes-Benz International Finance BV 22/08/2023      | 1 690 191           | 0,09                    |
| 3 100 000 0.250% Mercedes-Benz International Finance BV 06/11/2023      | 3 045 719           | 0,17                    |
| 1 189 000 0.000% Mercedes-Benz International Finance BV 08/02/2024      | 1 157 408           | 0,06                    |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 1 900 000 0.875% Mercedes-Benz International Finance BV 09/04/2024      | 1 855 122           | 0,10                    |
| 2 700 000 0.850% Mercedes-Benz International Finance BV 28/02/2025      | 2 595 456           | 0,15                    |
| 4 800 000 2.625% Mercedes-Benz International Finance BV 07/04/2025      | 4 750 800           | 0,27                    |
| 1 600 000 1.000% Mercedes-Benz International Finance BV 11/11/2025      | 1 509 280           | 0,08                    |
| 1 700 000 1.500% Mercedes-Benz International Finance BV 09/03/2026      | 1 627 427           | 0,09                    |
| 500 000 1.800% Mercialys SA 27/02/2026                                  | 446 680             | 0,03                    |
| 870 000 0.500% Merck & Co Inc 02/11/2024                                | 832 851             | 0,05                    |
| 1 000 000 0.005% Merck Financial Services GmbH 15/12/2023               | 977 230             | 0,05                    |
| 1 300 000 0.125% Merck Financial Services GmbH 16/07/2025               | 1 209 962           | 0,07                    |
| 750 000 3.375% Merck KGaA 12/12/2074                                    | 734 213             | 0,04                    |
| 900 000 1.625% Merck KGaA 25/06/2079                                    | 851 184             | 0,05                    |
| 800 000 2.225% Merlin Properties Socimi SA 25/04/2023                   | 799 064             | 0,04                    |
| 1 200 000 1.750% Merlin Properties Socimi SA 26/05/2025                 | 1 138 284           | 0,06                    |
| 900 000 1.500% METRO AG 19/03/2025                                      | 859 329             | 0,05                    |
| 2 179 000 0.375% Metropolitan Life Global Funding I 09/04/2024          | 2 105 437           | 0,12                    |
| 1 100 000 1.750% Metropolitan Life Global Funding I 25/05/2025          | 1 049 015           | 0,06                    |
| 400 000 0.000% Mitsubishi HC Capital UK PLC 29/10/2024                  | 376 020             | 0,02                    |
| 800 000 0.250% Mitsubishi HC Capital UK PLC 03/02/2025                  | 750 312             | 0,04                    |
| 767 000 0.980% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 09/10/2023            | 756 423             | 0,04                    |
| 700 000 0.978% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 09/06/2024            | 675 017             | 0,04                    |
| 1 000 000 0.339% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 19/07/2024          | 954 100             | 0,05                    |
| 1 200 000 0.872% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 07/09/2024          | 1 147 224           | 0,06                    |
| 1 800 000 2.264% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 14/06/2025          | 1 756 386           | 0,10                    |
| 2 200 000 3.273% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 19/09/2025          | 2 160 400           | 0,12                    |
| 720 000 1.020% Mizuho Financial Group Inc 11/10/2023                    | 709 898             | 0,04                    |
| 1 700 000 0.523% Mizuho Financial Group Inc 10/06/2024                  | 1 634 108           | 0,09                    |
| 900 000 0.118% Mizuho Financial Group Inc 06/09/2024                    | 853 470             | 0,05                    |

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 900 000 0.956% Mizuho Financial Group Inc 16/10/2024                    | 859 698             | 0,05                    |
| 1 000 000 0.214% Mizuho Financial Group Inc 07/10/2025                  | 915 670             | 0,05                    |
| 1 200 000 0.625% MMS USA Holdings Inc 13/06/2025                        | 1 120 956           | 0,06                    |
| 1 100 000 2.625% MOL Hungarian Oil & Gas PLC 28/04/2023                 | 1 097 558           | 0,06                    |
| 1 000 000 1.750% Molnlycke Holding AB 28/02/2024                        | 980 640             | 0,05                    |
| 900 000 1.875% Molnlycke Holding AB 28/02/2025                          | 866 070             | 0,05                    |
| 1 400 000 1.250% Molson Coors Beverage Co 15/07/2024                    | 1 350 818           | 0,08                    |
| 1 200 000 1.500% Mondi Finance PLC 15/04/2024                           | 1 171 212           | 0,07                    |
| 3 100 000 1.750% Morgan Stanley 11/03/2024                              | 3 041 100           | 0,17                    |
| 2 916 000 0.637% Morgan Stanley 26/07/2024                              | 2 887 423           | 0,16                    |
| 3 000 000 1.750% Morgan Stanley 30/01/2025                              | 2 906 610           | 0,16                    |
| 2 600 000 2.103% Morgan Stanley 08/05/2026                              | 2 494 180           | 0,14                    |
| 1 600 000 1.342% Morgan Stanley 23/10/2026                              | 1 498 896           | 0,08                    |
| 500 000 1.625% Motability Operations Group PLC 09/06/2023               | 498 530             | 0,03                    |
| 1 200 000 0.875% Motability Operations Group PLC 14/03/2025             | 1 141 140           | 0,06                    |
| 1 100 000 0.375% Motability Operations Group PLC 03/01/2026             | 1 009 866           | 0,06                    |
| 800 000 3.000% MTU Aero Engines AG 01/07/2025                           | 790 464             | 0,04                    |
| 700 000 0.875% Muenchener Hypothekbank eG 11/07/2024                    | 675 892             | 0,04                    |
| 600 000 0.875% Muenchener Hypothekbank eG 12/09/2025                    | 559 536             | 0,03                    |
| 700 000 2.125% Mylan Inc 23/05/2025                                     | 673 617             | 0,04                    |
| 890 000 0.625% National Australia Bank Ltd 30/08/2023                   | 880 059             | 0,05                    |
| 662 000 0.625% National Australia Bank Ltd 10/11/2023                   | 650 766             | 0,04                    |
| 1 000 000 0.250% National Australia Bank Ltd 20/05/2024                 | 961 940             | 0,05                    |
| 1 000 000 0.625% National Australia Bank Ltd 18/09/2024                 | 957 190             | 0,05                    |
| 900 000 0.190% National Grid Electricity Transmission PLC 20/01/2025    | 847 224             | 0,05                    |
| 800 000 0.750% National Grid North America Inc 08/08/2023               | 792 368             | 0,04                    |
| 800 000 1.000% National Grid North America Inc 12/07/2024               | 772 176             | 0,04                    |
| 900 000 0.410% National Grid North America Inc 20/01/2026               | 822 906             | 0,05                    |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 500 000 0.375% Nationale-Nederlanden Bank NV Netherlands 31/05/2023     | 497 760          | 0,03              |
| 900 000 0.375% Nationale-Nederlanden Bank NV Netherlands 26/02/2025     | 839 187          | 0,05              |
| 1 500 000 0.625% Nationwide Building Society 19/04/2023                 | 1 498 020        | 0,08              |
| 1 500 000 1.250% Nationwide Building Society 03/03/2025                 | 1 429 530        | 0,08              |
| 1 800 000 0.250% Nationwide Building Society 22/07/2025                 | 1 658 340        | 0,09              |
| 1 700 000 1.500% Nationwide Building Society 08/03/2026                 | 1 605 072        | 0,09              |
| 1 800 000 2.000% Nationwide Building Society 25/07/2029                 | 1 723 050        | 0,10              |
| 2 100 000 1.125% Naturgy Capital Markets SA 11/04/2024                  | 2 054 868        | 0,12              |
| 800 000 2.875% Naturgy Finance BV 11/03/2024                            | 794 568          | 0,04              |
| 1 300 000 0.875% Naturgy Finance BV 15/05/2025                          | 1 229 865        | 0,07              |
| 1 700 000 1.250% Naturgy Finance BV 15/01/2026                          | 1 589 755        | 0,09              |
| 1 300 000 2.000% NatWest Group PLC 04/03/2025                           | 1 271 194        | 0,07              |
| 1 600 000 0.750% NatWest Group PLC 15/11/2025                           | 1 511 936        | 0,08              |
| 2 800 000 1.750% NatWest Group PLC 02/03/2026                           | 2 665 544        | 0,15              |
| 800 000 1.125% NatWest Markets PLC 14/06/2023                           | 796 904          | 0,04              |
| 2 100 000 1.000% NatWest Markets PLC 28/05/2024                         | 2 029 356        | 0,11              |
| 2 000 000 2.750% NatWest Markets PLC 02/04/2025                         | 1 956 500        | 0,11              |
| 1 300 000 2.000% NatWest Markets PLC 27/08/2025                         | 1 244 295        | 0,07              |
| 1 400 000 0.125% NatWest Markets PLC 12/11/2025                         | 1 267 980        | 0,07              |
| 1 100 000 1.750% NE Property BV 23/11/2024                              | 1 029 028        | 0,06              |
| 750 000 0.750% Nestle Finance International Ltd 16/05/2023              | 747 900          | 0,04              |
| 1 050 000 0.375% Nestle Finance International Ltd 18/01/2024            | 1 031 226        | 0,06              |
| 1 450 000 0.000% Nestle Finance International Ltd 12/11/2024            | 1 384 257        | 0,08              |
| 1 000 000 0.000% Nestle Finance International Ltd 03/12/2025            | 922 910          | 0,05              |
| 1 400 000 0.875% Nestle Holdings Inc 18/07/2025                         | 1 334 844        | 0,07              |
| 900 000 1.125% NIBC Bank NV 19/04/2023                                  | 899 208          | 0,05              |
| 1 500 000 2.000% NIBC Bank NV 09/04/2024                                | 1 459 590        | 0,08              |
| 100 000 0.875% NIBC Bank NV 08/07/2025                                  | 91 686           | 0,01              |
| 900 000 0.046% Nidec Corp 30/03/2026                                    | 803 772          | 0,05              |
| 1 900 000 4.625% NN Group NV 08/04/2044                                 | 1 879 784        | 0,11              |
| 1 625 000 4.375% NN Group NV (Perpetual)                                | 1 592 987        | 0,09              |
| 1 700 000 4.500% NN Group NV (Perpetual)                                | 1 629 960        | 0,09              |

| Participation Investissement   | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>        |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 500 000 2.000% Nokia Oyj 15/03/2024                                      | 492 460          | 0,03              |
| 1 100 000 2.000% Nokia Oyj 11/03/2026                                    | 1 037 828        | 0,06              |
| 1 600 000 0.875% Nordea Bank Abp 26/06/2023                              | 1 591 632        | 0,09              |
| 2 700 000 1.125% Nordea Bank Abp 12/02/2025                              | 2 573 775        | 0,14              |
| 1 800 000 3.625% Nordea Bank Abp 10/02/2026                              | 1 793 376        | 0,10              |
| 500 000 1.000% Nordea Bank Abp 27/06/2029                                | 475 215          | 0,03              |
| 800 000 1.125% Norsk Hydro ASA 11/04/2025                                | 753 376          | 0,04              |
| 500 000 1.125% NOS SGPS SA 02/05/2023                                    | 498 855          | 0,03              |
| 500 000 6.000% Nova Ljubljanska Banka dd 19/07/2025                      | 492 245          | 0,03              |
| 1 300 000 0.500% Novartis Finance SA 14/08/2023                          | 1 287 806        | 0,07              |
| 2 100 000 0.125% Novartis Finance SA 20/09/2023                          | 2 070 243        | 0,12              |
| 1 250 000 0.000% Novo Nordisk Finance Netherlands BV 04/06/2024          | 1 202 713        | 0,07              |
| 900 000 0.750% Novo Nordisk Finance Netherlands BV 31/03/2025            | 854 505          | 0,05              |
| 1 700 000 0.010% NTT Finance Corp 03/03/2025                             | 1 589 704        | 0,09              |
| 1 200 000 0.082% NTT Finance Corp 13/12/2025                             | 1 096 440        | 0,06              |
| 1 000 000 0.875% Nykredit Realkredit AS 17/01/2024                       | 976 800          | 0,05              |
| 875 000 0.125% Nykredit Realkredit AS 10/07/2024                         | 831 390          | 0,05              |
| 1 400 000 0.625% Nykredit Realkredit AS 17/01/2025                       | 1 317 190        | 0,07              |
| 1 300 000 0.500% Nykredit Realkredit AS 10/07/2025                       | 1 202 513        | 0,07              |
| 1 000 000 0.250% Nykredit Realkredit AS 13/01/2026                       | 898 970          | 0,05              |
| 1 000 000 1.750% O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 05/07/2025 | 954 070          | 0,05              |
| 630 000 3.625% OCI NV 15/10/2025   | 615 863          | 0,03              |
| 700 000 5.625% Oldenburgische Landesbank AG 02/02/2026                   | 693 133          | 0,04              |
| 985 000 0.000% OMV AG 16/06/2023   | 978 913          | 0,05              |
| 900 000 0.750% OMV AG 04/12/2023   | 884 169          | 0,05              |
| 926 000 1.500% OMV AG 09/04/2024   | 907 452          | 0,05              |
| 1 150 000 0.000% OMV AG 03/07/2025                                       | 1 060 381        | 0,06              |
| 1 500 000 6.250% OMV AG (Perpetual)                                      | 1 539 765        | 0,09              |
| 600 000 2.875% OMV AG (Perpetual)  | 580 968          | 0,03              |
| 1 100 000 0.375% OP Corporate Bank plc 29/08/2023                        | 1 087 449        | 0,06              |
| 1 000 000 0.375% OP Corporate Bank plc 26/02/2024                        | 971 070          | 0,05              |
| 1 100 000 0.375% OP Corporate Bank plc 19/06/2024                        | 1 053 085        | 0,06              |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets | Participation Investissement   | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|--|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                     |                         | <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>        |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                     |                         | <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>  |                     |                         |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                     |                         | <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>  |                     |                         |
| 1 600 000 0.125% OP Corporate Bank plc 01/07/2024                       | 1 529 992           | 0,09                    | 1 200 000 5.625% Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA 01/02/2026  | 1 182 924           | 0,07                    |
| 1 100 000 1.000% OP Corporate Bank plc 22/05/2025                       | 1 040 105           | 0,06                    | 800 000 1.875% PPG Industries Inc 01/06/2025                             | 770 080             | 0,04                    |
| 1 800 000 0.500% OP Corporate Bank plc 12/08/2025                       | 1 671 588           | 0,09                    | 1 000 000 0.875% PPG Industries Inc 03/11/2025                           | 936 460             | 0,05                    |
| 1 100 000 2.875% OP Corporate Bank plc 15/12/2025                       | 1 075 294           | 0,06                    | 2 100 000 1.125% Procter & Gamble Co 02/11/2023                          | 2 074 380           | 0,12                    |
| 700 000 0.250% OP Corporate Bank plc 24/03/2026                         | 626 521             | 0,04                    | 900 000 0.500% Procter & Gamble Co 25/10/2024                            | 861 435             | 0,05                    |
| 1 600 000 1.625% OP Corporate Bank plc 09/06/2030                       | 1 475 056           | 0,08                    | 1 500 000 0.625% Procter & Gamble Co 30/10/2024                          | 1 441 995           | 0,08                    |
| 1 300 000 3.125% Oracle Corp 10/07/2025                                 | 1 295 814           | 0,07                    | 400 000 1.876% Prologis International Funding II SA 17/04/2025           | 377 032             | 0,02                    |
| 900 000 0.750% Orange SA 11/09/2023                                     | 890 280             | 0,05                    | 500 000 1.375% Prosegur Cash SA 04/02/2026                               | 469 080             | 0,03                    |
| 1 300 000 3.125% Orange SA 09/01/2024                                   | 1 297 959           | 0,07                    | 1 000 000 1.207% Prosus NV 19/01/2026                                    | 894 010             | 0,05                    |
| 2 800 000 1.125% Orange SA 15/07/2024                                   | 2 724 932           | 0,15                    | 800 000 0.750% PSA Banque France SA 19/04/2023                           | 799 192             | 0,04                    |
| 1 200 000 1.000% Orange SA 12/05/2025                                   | 1 142 412           | 0,06                    | 900 000 0.625% PSA Banque France SA 21/06/2024                           | 867 096             | 0,05                    |
| 1 100 000 1.000% Orange SA 12/09/2025                                   | 1 039 709           | 0,06                    | 1 000 000 0.000% PSA Banque France SA 22/01/2025                         | 935 450             | 0,05                    |
| 1 800 000 5.250% Orange SA (Perpetual)                                  | 1 797 714           | 0,10                    | 900 000 3.875% PSA Banque France SA 19/01/2026                           | 897 318             | 0,05                    |
| 2 300 000 2.375% Orange SA (Perpetual)                                  | 2 182 194           | 0,12                    | 900 000 0.500% Publicis Groupe SA 03/11/2023                             | 884 772             | 0,05                    |
| 1 500 000 2.500% ORLEN Capital AB 07/06/2023                            | 1 496 430           | 0,08                    | 900 000 1.625% Publicis Groupe SA 16/12/2024                             | 870 894             | 0,05                    |
| 700 000 5.500% OTP Bank Nyrt 13/07/2025                                 | 695 506             | 0,04                    | 900 000 3.625% PVH Corp 15/07/2024                                       | 892 503             | 0,05                    |
| 1 200 000 7.350% OTP Bank Nyrt 04/03/2026                               | 1 205 640           | 0,07                    | 800 000 6.000% Raiffeisen Bank International AG 16/10/2023               | 787 512             | 0,04                    |
| 500 000 0.875% P3 Group Sarl 26/01/2026                                 | 429 675             | 0,02                    | 400 000 1.000% Raiffeisen Bank International AG 04/12/2023               | 391 464             | 0,02                    |
| 1 000 000 3.250% PACCAR Financial Europe BV 29/11/2025                  | 995 740             | 0,06                    | 1 200 000 0.250% Raiffeisen Bank International AG 22/01/2025             | 1 102 788           | 0,06                    |
| 500 000 0.000% PACCAR Financial Europe BV 01/03/2026                    | 454 510             | 0,03                    | 900 000 4.125% Raiffeisen Bank International AG 08/09/2025               | 884 763             | 0,05                    |
| 1 100 000 1.125% Parker-Hannifin Corp 01/03/2025                        | 1 041 557           | 0,06                    | 1 900 000 4.750% Raiffeisen Bank International AG 26/01/2027             | 1 853 279           | 0,10                    |
| 600 000 1.375% Pearson Funding PLC 06/05/2025                           | 572 508             | 0,03                    | 1 100 000 1.500% Raiffeisen Bank International AG 12/03/2030             | 905 322             | 0,05                    |
| 1 700 000 0.250% PepsiCo Inc 06/05/2024                                 | 1 645 719           | 0,09                    | 500 000 8.750% Raiffeisen Bank zrt 22/11/2025                            | 505 320             | 0,03                    |
| 800 000 0.000% Pernod Ricard SA 24/10/2023                              | 784 888             | 0,04                    | 900 000 7.125% Raiffeisenbank AS 19/01/2026                              | 896 769             | 0,05                    |
| 1 200 000 2.125% Pernod Ricard SA 27/09/2024                            | 1 177 704           | 0,07                    | 700 000 0.250% Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG 16/04/2024 | 670 985             | 0,04                    |
| 1 900 000 1.125% Pernod Ricard SA 07/04/2025                            | 1 814 291           | 0,10                    | 700 000 0.750% Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG 22/05/2023        | 697 662             | 0,04                    |
| 2 100 000 2.875% Philip Morris International Inc 30/05/2024             | 2 079 336           | 0,12                    | 1 311 000 0.750% RCI Banque SA 10/04/2023                                | 1 310 384           | 0,07                    |
| 700 000 0.625% Philip Morris International Inc 08/11/2024               | 665 049             | 0,04                    | 600 000 1.000% RCI Banque SA 17/05/2023                                  | 598 242             | 0,03                    |
| 400 000 2.750% Philip Morris International Inc 19/03/2025               | 392 172             | 0,02                    | 750 000 0.500% RCI Banque SA 15/09/2023                                  | 739 073             | 0,04                    |
| 1 700 000 2.875% Philip Morris International Inc 03/03/2026             | 1 670 743           | 0,09                    | 1 400 000 1.375% RCI Banque SA 08/03/2024                                | 1 367 002           | 0,08                    |
| 1 000 000 0.500% POSCO 17/01/2024                                       | 972 380             | 0,05                    | 1 620 000 2.000% RCI Banque SA 11/07/2024                                | 1 577 329           | 0,09                    |
| 600 000 1.000% PostNL NV 21/11/2024                                     | 568 902             | 0,03                    |  |                     |                         |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 1 650 000 1.625% RCI Banque SA 11/04/2025                               | 1 565 998        | 0,09              | 1 700 000 2.500% Sanofi 14/11/2023                                      | 1 692 486        | 0,09              |
| 1 300 000 0.500% RCI Banque SA 14/07/2025                               | 1 194 765        | 0,07              | 1 000 000 0.625% Sanofi 05/04/2024                                      | 973 890          | 0,05              |
| 1 700 000 4.125% RCI Banque SA 01/12/2025                               | 1 699 388        | 0,10              | 1 800 000 1.000% Sanofi 01/04/2025                                      | 1 723 482        | 0,10              |
| 600 000 0.875% Red Electrica Corp SA 14/04/2025                         | 570 162          | 0,03              | 1 500 000 0.875% Sanofi 06/04/2025                                      | 1 433 460        | 0,08              |
| 600 000 2.125% Red Electrica Financiaciones SAU 01/07/2023              | 598 320          | 0,03              | 1 300 000 1.500% Sanofi 22/09/2025                                      | 1 247 571        | 0,07              |
| 900 000 1.125% Red Electrica Financiaciones SAU 24/04/2025              | 863 190          | 0,05              | 2 600 000 1.000% Sanofi 21/03/2026                                      | 2 449 552        | 0,14              |
| 1 000 000 1.875% Redexis Gas Finance BV 28/05/2025                      | 955 990          | 0,05              | 800 000 0.250% Santander Consumer Bank AG 15/10/2024                    | 754 360          | 0,04              |
| 1 000 000 1.300% RELX Capital Inc 12/05/2025                            | 955 180          | 0,05              | 900 000 0.125% Santander Consumer Bank AS 11/09/2024                    | 849 798          | 0,05              |
| 1 400 000 0.000% RELX Finance BV 18/03/2024                             | 1 354 696        | 0,08              | 1 100 000 0.125% Santander Consumer Bank AS 25/02/2025                  | 1 020 470        | 0,06              |
| 900 000 1.000% RELX Finance BV 22/03/2024                               | 875 709          | 0,05              | 800 000 0.500% Santander Consumer Bank AS 11/08/2025                    | 735 984          | 0,04              |
| 600 000 1.750% Ren Finance BV 01/06/2023                                | 598 614          | 0,03              | 1 200 000 0.875% Santander Consumer Finance SA 30/05/2023               | 1 195 560        | 0,07              |
| 600 000 2.500% Ren Finance BV 12/02/2025                                | 592 812          | 0,03              | 1 300 000 1.125% Santander Consumer Finance SA 09/10/2023               | 1 283 737        | 0,07              |
| 1 000 000 0.950% Rentokil Initial PLC 22/11/2024                        | 958 700          | 0,05              | 2 100 000 1.000% Santander Consumer Finance SA 27/02/2024               | 2 047 836        | 0,11              |
| 1 700 000 0.125% Repsol International Finance BV 05/10/2024             | 1 619 794        | 0,09              | 2 100 000 0.375% Santander Consumer Finance SA 27/06/2024               | 2 012 934        | 0,11              |
| 1 500 000 2.000% Repsol International Finance BV 15/12/2025             | 1 450 860        | 0,08              | 1 700 000 0.375% Santander Consumer Finance SA 17/01/2025               | 1 598 969        | 0,09              |
| 1 400 000 4.500% Repsol International Finance BV 25/03/2025             | 1 360 380        | 0,08              | 500 000 1.125% Santander UK Group Holdings PLC 08/09/2023               | 495 030          | 0,03              |
| 2 600 000 1.000% Richemont International Holding SA 26/03/2026          | 2 454 894        | 0,14              | 1 900 000 0.391% Santander UK Group Holdings PLC 28/02/2025             | 1 830 973        | 0,10              |
| 700 000 2.875% Rio Tinto Finance PLC 11/12/2024                         | 691 215          | 0,04              | 700 000 1.125% Santander UK PLC 10/03/2025                              | 665 483          | 0,04              |
| 500 000 1.625% Roadster Finance DAC 09/12/2029                          | 444 055          | 0,02              | 800 000 0.000% SAP SE 17/05/2023  | 796 912          | 0,04              |
| 1 100 000 1.750% Robert Bosch GmbH 08/07/2024                           | 1 080 629        | 0,06              | 1 500 000 0.750% SAP SE 10/12/2024                                      | 1 438 995        | 0,08              |
| 1 600 000 0.875% Roche Finance Europe BV 25/02/2025                     | 1 545 840        | 0,09              | 900 000 1.000% SAP SE 01/04/2025  | 869 058          | 0,05              |
| 1 000 000 0.250% Royal Bank of Canada 02/05/2024                        | 963 390          | 0,05              | 900 000 1.000% SAP SE 13/03/2026  | 851 033          | 0,05              |
| 1 900 000 0.125% Royal Bank of Canada 23/07/2024                        | 1 813 683        | 0,10              | 600 000 1.375% SATO Oyj 31/05/2024                                      | 593 474          | 0,03              |
| 2 200 000 2.500% RWE AG 24/08/2025                                      | 2 154 878        | 0,12              | 1 265 000 0.500% Scania CV AB 06/10/2023                                | 1 245 943        | 0,07              |
| 1 350 000 1.125% Ryanair DAC 15/08/2023                                 | 1 338 660        | 0,07              | 400 000 2.250% Scania CV AB 03/06/2025                                  | 387 620          | 0,02              |
| 1 600 000 2.875% Ryanair DAC 15/09/2025                                 | 1 565 779        | 0,09              | 960 000 2.250% Scentre Group Trust 1 16/07/2024                         | 928 858          | 0,05              |
| 1 200 000 0.125% Safran SA 16/03/2026                                   | 1 088 976        | 0,06              | 900 000 3.250% Scentre Group Trust 2 11/09/2023                         | 894 321          | 0,05              |
| 700 000 2.250% Sagax AB 13/03/2025                                      | 658 658          | 0,04              | 1 100 000 0.000% Schlumberger Finance BV 15/10/2024                     | 1 043 944        | 0,06              |
| 500 000 1.625% Sagax Euro Mtn NL BV 24/02/2026                          | 437 280          | 0,02              | 1 000 000 1.000% Schlumberger Finance France SAS 18/02/2026             | 933 130          | 0,05              |
| 800 000 1.750% Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 14/01/2025           | 698 656          | 0,04              | 500 000 0.000% Schneider Electric SE 12/06/2023                         | 496 865          | 0,03              |
| 250 000 1.000% Sampo Oyj 18/09/2023                                     | 247 563          | 0,01              | 1 600 000 1.500% Schneider Electric SE 08/09/2023                       | 1 588 368        | 0,09              |
| 1 000 000 1.875% SANEF SA 16/03/2026                                    | 955 450          | 0,05              |   |                  |                   |



## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR   | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR   | % des actifs nets |
|---|--|-------------------|---|--|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |  |                   |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |  |                   | <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |  |                   |
| 1 600 000   | 0.250% Schneider Electric SE<br>09/09/2024                   | 1 537 552 0,09    | 2 236 000   | 1.375% Skandinaviska Enskilda Banken<br>AB 31/10/2028                                | 2 186 763 0,12    |
| 1 400 000   | 0.875% Schneider Electric SE<br>11/03/2025                   | 1 341 060 0,08    | 500 000   | 1.250% SKF AB 17/09/2025   | 473 695 0,03      |
| 700 000   | 1.125% Securitas AB 20/02/2024                               | 682 731 0,04      | 1 500 000   | 1.875% Sky Ltd 24/11/2023  | 1 485 960 0,08    |
| 900 000   | 1.500% SELP Finance Sarl 20/11/2025                          | 812 511 0,05      | 800 000   | 2.250% Sky Ltd 17/11/2025  | 774 416 0,04      |
| 1 100 000   | 1.625% SES SA 22/03/2026                                     | 1 015 828 0,06    | 1 250 000   | 1.250% Smiths Group PLC 28/04/2023   | 1 247 688 0,07    |
| 1 775 000   | 1.125% Shell International Finance BV<br>07/04/2024          | 1 734 264 0,10    | 2 000 000   | 2.875% Smurfit Kappa Acquisitions ULC<br>15/01/2026                                  | 1 932 500 0,11    |
| 1 800 000   | 0.500% Shell International Finance BV<br>11/05/2024          | 1 744 506 0,10    | 753 000   | 1.000% Snam SpA 18/09/2023   | 743 904 0,04      |
| 1 000 000   | 0.750% Shell International Finance BV<br>12/05/2024          | 973 620 0,05      | 600 000   | 3.250% Snam SpA 22/01/2024   | 598 668 0,03      |
| 2 200 000   | 0.375% Shell International Finance BV<br>15/02/2025          | 2 083 466 0,12    | 1 648 000   | 0.000% Snam SpA 12/05/2024   | 1 584 156 0,09    |
| 1 800 000   | 1.875% Shell International Finance BV<br>15/09/2025          | 1 745 262 0,10    | 1 200 000   | 0.000% Snam SpA 15/08/2025   | 1 105 020 0,06    |
| 1 700 000   | 2.500% Shell International Finance BV<br>24/03/2026          | 1 675 061 0,09    | 1 000 000   | 1.250% Snam SpA 28/08/2025   | 948 620 0,05      |
| 1 100 000   | 0.250% Shinhan Bank Co Ltd<br>16/10/2024                     | 1 039 962 0,06    | 700 000   | 1.500% Societe Fonciere Lyonnaise SA<br>29/05/2025                                   | 667 135 0,04      |
| 1 800 000   | 0.375% Siemens<br>Financieringsmaatschappij NV<br>06/09/2023 | 1 778 616 0,10    | 1 600 000   | 0.750% Societe Generale SA<br>26/05/2023   | 1 594 848 0,09    |
| 1 387 000   | 0.300% Siemens<br>Financieringsmaatschappij NV<br>28/02/2024 | 1 351 978 0,08    | 1 400 000   | 4.000% Societe Generale SA<br>07/06/2023   | 1 398 698 0,08    |
| 1 600 000   | 0.250% Siemens<br>Financieringsmaatschappij NV<br>05/06/2024 | 1 544 528 0,09    | 3 200 000   | 1.250% Societe Generale SA<br>15/02/2024   | 3 129 024 0,18    |
| 1 100 000   | 0.000% Siemens<br>Financieringsmaatschappij NV<br>05/09/2024 | 1 052 172 0,06    | 2 300 000   | 1.125% Societe Generale SA<br>23/01/2025   | 2 191 785 0,12    |
| 2 200 000   | 2.250% Siemens<br>Financieringsmaatschappij NV<br>10/03/2025 | 2 157 672 0,12    | 2 400 000   | 2.625% Societe Generale SA<br>27/02/2025   | 2 329 536 0,13    |
| 1 000 000   | 0.000% Siemens<br>Financieringsmaatschappij NV<br>20/02/2026 | 913 150 0,05      | 2 400 000   | 1.500% Societe Generale SA<br>30/05/2025   | 2 331 024 0,13    |
| 1 000 000   | 2.625% Sigma Alimentos SA de CV<br>07/02/2024                | 983 770 0,06      | 2 000 000   | 0.125% Societe Generale SA<br>24/02/2026   | 1 801 040 0,10    |
| 1 105 000   | 2.000% Signify NV 11/05/2024                                 | 1 082 149 0,06    | 1 500 000   | 1.125% Societe Generale SA<br>21/04/2026   | 1 404 315 0,08    |
| 900 000   | 1.250% Simon International Finance<br>SCA 13/05/2025         | 844 452 0,05      | 1 700 000   | 0.125% Societe Generale SA<br>17/11/2026   | 1 538 347 0,09    |
| 1 200 000   | 0.000% SIX Finance Luxembourg SA<br>02/12/2025               | 1 089 132 0,06    | 1 700 000   | 1.000% Societe Generale SA<br>24/11/2030   | 1 496 510 0,08    |
| 1 753 000   | 0.250% Skandinaviska Enskilda Banken<br>AB 19/05/2023        | 1 746 917 0,10    | 800 000   | 0.500% Sodexo SA 17/01/2024  | 783 008 0,04      |
| 700 000   | 0.050% Skandinaviska Enskilda Banken<br>AB 01/07/2024        | 669 270 0,04      | 1 100 000   | 0.750% Sodexo SA 27/04/2025  | 1 039 038 0,06    |
| 2 300 000   | 3.250% Skandinaviska Enskilda Banken<br>AB 24/11/2025        | 2 264 580 0,13    | 1 500 000   | 4.125% Sogecap SA (Perpetual)<br>800 000 0.250% Sparebank 1 Oestlandet<br>30/09/2024 | 1 420 200 0,08    |
|   |  |                   | 900 000   | 0.750% SpareBank 1 SMN 03/07/2023  | 756 888 0,04      |
|   |  |                   | 1 000 000   | 3.125% SpareBank 1 SMN 22/12/2025  | 894 438 0,05      |
|   |  |                   | 1 400 000   | 0.625% SpareBank 1 SR-Bank ASA<br>25/03/2024   | 977 800 0,05      |
|   |  |                   | 900 000   | 2.875% SpareBank 1 SR-Bank ASA<br>20/09/2025   | 1 354 808 0,08    |
|   |  |                   | 1 150 000   | 1.750% SSE PLC 08/09/2023  | 878 967 0,05      |
|   |  |                   | 1 100 000   | 1.250% SSE PLC 16/04/2025  | 1 141 088 0,06    |
|   |  |                   |   |  | 1 050 940 0,06    |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 1 000 000 0.875% SSE PLC 06/09/2025                                     | 939 970             | 0,05                    |
| 900 000 3.125% Standard Chartered PLC 19/11/2024                        | 885 519             | 0,05                    |
| 1 600 000 2.500% Standard Chartered PLC 09/09/2030                      | 1 499 280           | 0,08                    |
| 2 466 000 3.375% Stellantis NV 07/07/2023                               | 2 466 690           | 0,14                    |
| 1 350 000 2.000% Stellantis NV 23/03/2024                               | 1 331 100           | 0,07                    |
| 2 370 000 3.750% Stellantis NV 29/03/2024                               | 2 370 000           | 0,13                    |
| 1 500 000 2.000% Stellantis NV 20/03/2025                               | 1 456 500           | 0,08                    |
| 2 000 000 3.875% Stellantis NV 05/01/2026                               | 2 005 340           | 0,11                    |
| 500 000 1.375% STG Global Finance BV 24/09/2025                         | 456 930             | 0,03                    |
| 400 000 2.125% Stora Enso Oyj 16/06/2023                                | 399 120             | 0,02                    |
| 1 500 000 1.125% Stryker Corp 30/11/2023                                | 1 477 545           | 0,08                    |
| 1 500 000 0.250% Stryker Corp 03/12/2024                                | 1 422 645           | 0,08                    |
| 500 000 1.250% Sudzucker International Finance BV 29/11/2023            | 491 650             | 0,03                    |
| 900 000 1.000% Sudzucker International Finance BV 28/11/2025            | 848 502             | 0,05                    |
| 800 000 2.750% Sumitomo Mitsui Banking Corp 24/07/2023                  | 798 168             | 0,04                    |
| 950 000 0.819% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 23/07/2023           | 942 001             | 0,05                    |
| 1 400 000 0.465% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 30/05/2024         | 1 346 338           | 0,08                    |
| 900 000 0.934% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 11/10/2024           | 860 877             | 0,05                    |
| 1 800 000 0.125% Svenska Handelsbanken AB 18/06/2024                    | 1 725 372           | 0,10                    |
| 2 900 000 1.000% Svenska Handelsbanken AB 15/04/2025                    | 2 761 641           | 0,15                    |
| 1 500 000 1.625% Svenska Handelsbanken AB 05/03/2029                    | 1 447 125           | 0,08                    |
| 920 000 0.400% Swedbank AB 29/08/2023                                   | 909 291             | 0,05                    |
| 1 200 000 0.250% Swedbank AB 09/10/2024                                 | 1 135 416           | 0,06                    |
| 1 800 000 0.750% Swedbank AB 05/05/2025                                 | 1 689 084           | 0,09                    |
| 1 900 000 3.750% Swedbank AB 14/11/2025                                 | 1 898 119           | 0,11                    |
| 772 000 1.500% Swedbank AB 18/09/2028                                   | 759 903             | 0,04                    |
| 1 000 000 0.875% Swedish Match AB 23/09/2024                            | 954 070             | 0,05                    |
| 500 000 1.200% Swedish Match AB 10/11/2025                              | 466 320             | 0,03                    |
| 1 350 000 1.375% Swiss Re Finance UK PLC 27/05/2023                     | 1 345 788           | 0,08                    |
| 1 000 000 1.375% Sydbank AS 18/09/2023                                  | 989 370             | 0,06                    |
| 900 000 4.750% Sydbank AS 30/09/2025                                    | 896 481             | 0,05                    |
| 800 000 0.500% Sydbank AS 10/11/2026                                    | 713 792             | 0,04                    |
| 1 000 000 2.750% Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 23/04/2024           | 989 350             | 0,06                    |
| 900 000 1.250% Sysco Corp 23/06/2023                                    | 896 067             | 0,05                    |

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 675 000 1.000% Talent Yield Euro Ltd 24/09/2025                         | 618 759             | 0,03                    |
| 600 000 5.952% Tatra Banka as 17/02/2026                                | 591 084             | 0,03                    |
| 1 000 000 1.125% Tele2 AB 15/05/2024                                    | 969 200             | 0,05                    |
| 950 000 1.875% Telefonaktiebolaget LM Ericsson 01/03/2024               | 930 278             | 0,05                    |
| 1 700 000 1.069% Telefonica Emisiones SA 05/02/2024                     | 1 667 190           | 0,09                    |
| 1 900 000 1.528% Telefonica Emisiones SA 17/01/2025                     | 1 841 765           | 0,10                    |
| 1 600 000 1.495% Telefonica Emisiones SA 11/09/2025                     | 1 530 416           | 0,09                    |
| 600 000 3.500% Telekom Finanzmanagement GmbH 04/07/2023                 | 599 946             | 0,03                    |
| 1 000 000 1.875% Teleperformance 02/07/2025                             | 937 830             | 0,05                    |
| 1 100 000 3.625% Telia Co AB 14/02/2024                                 | 1 099 494           | 0,06                    |
| 1 000 000 3.875% Telia Co AB 01/10/2025                                 | 1 004 480           | 0,06                    |
| 1 700 000 2.500% Telstra Corp Ltd 15/09/2023                            | 1 692 673           | 0,09                    |
| 300 000 2.200% Terega SA 05/08/2025                                     | 292 017             | 0,02                    |
| 1 700 000 1.000% Tema - Rete Elettrica Nazionale 23/07/2023             | 1 689 273           | 0,09                    |
| 1 240 000 4.900% Tema - Rete Elettrica Nazionale 28/10/2024             | 1 264 217           | 0,07                    |
| 900 000 0.125% Tema - Rete Elettrica Nazionale 25/07/2025               | 834 192             | 0,05                    |
| 1 400 000 1.375% Tesco Corporate Treasury Services PLC 24/10/2023       | 1 383 270           | 0,08                    |
| 700 000 2.500% Tesco Corporate Treasury Services PLC 01/07/2024         | 690 998             | 0,04                    |
| 1 400 000 0.750% Thales SA 07/06/2023                                   | 1 394 960           | 0,08                    |
| 900 000 0.875% Thales SA 19/04/2024                                     | 876 168             | 0,05                    |
| 600 000 0.750% Thales SA 23/01/2025                                     | 570 654             | 0,03                    |
| 900 000 0.000% Thales SA 26/03/2026                                     | 811 827             | 0,05                    |
| 1 000 000 0.000% Thermo Fisher Scientific Finance I BV 18/11/2023       | 979 710             | 0,05                    |
| 1 000 000 0.000% Thermo Fisher Scientific Finance I BV 18/11/2025       | 916 160             | 0,05                    |
| 2 100 000 0.750% Thermo Fisher Scientific Inc 12/09/2024                | 2 020 284           | 0,11                    |
| 1 400 000 0.125% Thermo Fisher Scientific Inc 01/03/2025                | 1 315 104           | 0,07                    |
| 1 200 000 2.000% Thermo Fisher Scientific Inc 15/04/2025                | 1 164 828           | 0,07                    |
| 700 000 3.200% Thermo Fisher Scientific Inc 21/01/2026                  | 696 871             | 0,04                    |
| 1 000 000 1.400% Thermo Fisher Scientific Inc 23/01/2026                | 948 260             | 0,05                    |
| 2 700 000 0.625% Toronto-Dominion Bank 20/07/2023                       | 2 679 750           | 0,15                    |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR   | % des<br>actifs<br>nets | Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets                              |           |      |
|---|---|-------------------------|---|---------------------|--|-----------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |   |                         | <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                     |  |           |      |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |   |                         | <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                     |  |           |      |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |   |                         | <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                     |  |           |      |
| 2 600 000   | 0.375% Toronto-Dominion Bank<br>25/04/2024                  | 2 511 314               | 0,14  | 2 800 000           | 0.250% UBS Group AG 29/01/2026                       | 2 576 980 | 0,14 |
| 2 100 000   | 0.250% TotalEnergies Capital<br>International SA 12/07/2023 | 2 082 864               | 0,12  | 2 000 000           | 0.250% UBS Group AG 03/11/2026                       | 1 785 360 | 0,10 |
| 900 000   | 0.625% TotalEnergies Capital<br>International SA 04/10/2024 | 866 916                 | 0,05  | 700 000             | 2.500% Unibail-Rodamco-Westfield SE<br>12/06/2023    | 698 257   | 0,04 |
| 1 300 000   | 1.375% TotalEnergies Capital<br>International SA 19/03/2025 | 1 259 167               | 0,07  | 1 300 000           | 2.500% Unibail-Rodamco-Westfield SE<br>26/02/2024    | 1 284 075 | 0,07 |
| 1 900 000   | 2.500% TotalEnergies Capital<br>International SA 25/03/2026 | 1 875 927               | 0,11  | 800 000             | 0.875% Unibail-Rodamco-Westfield SE<br>21/02/2025    | 752 368   | 0,04 |
| 2 200 000   | 5.125% TotalEnergies Capital SA<br>26/03/2024               | 2 242 394               | 0,13  | 900 000             | 1.000% Unibail-Rodamco-Westfield SE<br>14/03/2025    | 847 701   | 0,05 |
| 4 700 000   | 2.625% TotalEnergies SE (Perpetual)                         | 4 445 119               | 0,25  | 1 000 000           | 2.125% Unibail-Rodamco-Westfield SE<br>09/04/2025    | 958 560   | 0,05 |
| 1 700 000   | 2.708% TotalEnergies SE (Perpetual)                         | 1 695 529               | 0,09  | 1 400 000           | 1.125% Unibail-Rodamco-Westfield SE<br>15/09/2025    | 1 293 726 | 0,07 |
| 2 900 000   | 1.750% TotalEnergies SE (Perpetual)                         | 2 784 087               | 0,16  | 900 000             | 1.375% Unibail-Rodamco-Westfield SE<br>09/03/2026    | 833 364   | 0,05 |
| 824 000   | 0.500% Toyota Finance Australia Ltd<br>06/04/2023           | 823 885                 | 0,05  | 2 200 000           | 2.125% Unibail-Rodamco-Westfield SE<br>(Perpetual)   | 1 879 768 | 0,11 |
| 1 000 000   | 0.250% Toyota Finance Australia Ltd<br>09/04/2024           | 968 180                 | 0,05  | 800 000             | 4.500% Unicaja Banco SA 30/06/2025                   | 797 256   | 0,04 |
| 800 000   | 2.004% Toyota Finance Australia Ltd<br>21/10/2024           | 783 032                 | 0,04  | 1 100 000           | 1.000% Unicaja Banco SA 01/12/2026                   | 986 667   | 0,06 |
| 1 100 000   | 0.064% Toyota Finance Australia Ltd<br>13/01/2025           | 1 034 198               | 0,06  | 1 700 000           | 0.500% UniCredit SpA 09/04/2025                      | 1 591 727 | 0,09 |
| 900 000   | 0.625% Toyota Motor Credit Corp<br>21/11/2024               | 861 579                 | 0,05  | 2 100 000           | 1.250% UniCredit SpA 25/06/2025                      | 2 026 332 | 0,11 |
| 1 100 000   | 0.625% Toyota Motor Finance<br>Netherlands BV 26/09/2023    | 1 085 205               | 0,06  | 1 700 000           | 1.625% UniCredit SpA 03/07/2025                      | 1 643 186 | 0,09 |
| 1 700 000   | 0.000% Toyota Motor Finance<br>Netherlands BV 27/10/2025    | 1 554 565               | 0,09  | 1 750 000           | 0.325% UniCredit SpA 19/01/2026                      | 1 584 240 | 0,09 |
| 1 300 000   | 3.375% Toyota Motor Finance<br>Netherlands BV 13/01/2026    | 1 293 695               | 0,07  | 2 300 000           | 1.200% UniCredit SpA 20/01/2026                      | 2 163 633 | 0,12 |
| 1 050 000   | 1.875% Transurban Finance Co Pty Ltd<br>16/09/2024          | 1 021 220               | 0,06  | 2 200 000           | 1.250% UniCredit SpA 16/06/2026                      | 2 061 664 | 0,12 |
| 1 000 000   | 2.000% Transurban Finance Co Pty Ltd<br>28/08/2025          | 957 720                 | 0,05  | 600 000             | 1.000% Unilever Finance Netherlands<br>BV 03/06/2023 | 597 570   | 0,03 |
| 1 000 000   | 0.000% Traton Finance Luxembourg SA<br>14/06/2024           | 958 290                 | 0,05  | 400 000             | 0.500% Unilever Finance Netherlands<br>BV 12/08/2023 | 396 392   | 0,02 |
| 1 200 000   | 0.125% Traton Finance Luxembourg SA<br>10/11/2024           | 1 134 240               | 0,06  | 900 000             | 0.500% Unilever Finance Netherlands<br>BV 29/04/2024 | 873 297   | 0,05 |
| 2 100 000   | 0.125% Traton Finance Luxembourg SA<br>24/03/2025           | 1 952 832               | 0,11  | 1 200 000           | 0.500% Unilever Finance Netherlands<br>BV 06/01/2025 | 1 141 704 | 0,06 |
| 1 000 000   | 4.125% Traton Finance Luxembourg SA<br>22/11/2025           | 1 004 760               | 0,06  | 2 000 000           | 1.250% Unilever Finance Netherlands<br>BV 25/03/2025 | 1 926 060 | 0,11 |
| 900 000   | 0.000% Tyco Electronics Group SA<br>14/02/2025              | 843 876                 | 0,05  | 1 300 000           | 0.875% Unilever Finance Netherlands<br>BV 31/07/2025 | 1 232 504 | 0,07 |
| 2 000 000   | 0.010% UBS AG/London 31/03/2026                             | 1 784 040               | 0,10  | 500 000             | 0.750% Unilever Finance Netherlands<br>BV 28/02/2026 | 464 900   | 0,03 |
| 1 325 000   | 2.125% UBS Group AG 04/03/2024                              | 1 301 229               | 0,07  | 1 200 000           | 0.375% United Parcel Service Inc<br>15/11/2023       | 1 178 616 | 0,07 |
| 2 000 000   | 1.500% UBS Group AG 30/11/2024                              | 1 908 000               | 0,11  | 1 200 000           | 1.625% United Parcel Service Inc<br>15/11/2025       | 1 147 272 | 0,06 |
| 3 300 000   | 1.000% UBS Group AG 21/03/2025                              | 3 187 140               | 0,18  | 1 500 000           | 1.023% Upjohn Finance BV 23/06/2024                  | 1 446 735 | 0,08 |
| 3 100 000   | 1.250% UBS Group AG 17/04/2025                              | 2 991 283               | 0,17  | 2 100 000           | 0.850% US Bancorp 07/06/2024                         | 2 012 409 | 0,11 |
|   |   |                         |   | 1 700 000           | 2.250% Utah Acquisition Sub Inc<br>22/11/2024        | 1 654 304 | 0,09 |
|   |   |                         |   | 1 300 000           | 0.000% Vantage Towers AG 31/03/2025                  | 1 300 000 | 0,07 |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 1 000 000 0.314% Veolia Environnement SA 04/10/2023                     | 984 550          | 0,06              |
| 1 200 000 2.750% Veolia Environnement SA 09/10/2023                     | 1 194 696        | 0,07              |
| 1 300 000 0.892% Veolia Environnement SA 14/01/2024                     | 1 275 820        | 0,07              |
| 700 000 5.500% Veolia Environnement SA 22/07/2024                       | 716 366          | 0,04              |
| 900 000 1.000% Veolia Environnement SA 03/04/2025                       | 857 736          | 0,05              |
| 300 000 1.750% Veolia Environnement SA 10/09/2025                       | 288 849          | 0,02              |
| 1 400 000 2.875% Veolia Environnement SA (Perpetual)                    | 1 366 988        | 0,08              |
| 1 100 000 1.625% Verizon Communications Inc 01/03/2024                  | 1 080 629        | 0,06              |
| 1 700 000 0.875% Verizon Communications Inc 02/04/2025                  | 1 613 776        | 0,09              |
| 2 200 000 3.250% Verizon Communications Inc 17/02/2026                  | 2 183 742        | 0,12              |
| 1 451 000 0.625% VF Corp 20/09/2023                                     | 1 429 917        | 0,08              |
| 1 000 000 4.125% VF Corp 07/03/2026                                     | 1 005 740        | 0,06              |
| 1 400 000 3.125% Vier Gas Transport GmbH 10/07/2023                     | 1 398 082        | 0,08              |
| 1 000 000 2.875% Vier Gas Transport GmbH 12/06/2025                     | 976 840          | 0,05              |
| 1 100 000 1.000% Vinci SA 26/09/2025                                    | 1 047 640        | 0,06              |
| 1 000 000 0.375% Virgin Money UK PLC 27/05/2024                         | 993 010          | 0,06              |
| 600 000 2.875% Virgin Money UK PLC 24/06/2025                           | 577 236          | 0,03              |
| 800 000 0.375% Vterra Finance BV 24/09/2025                             | 722 224          | 0,04              |
| 1 100 000 1.125% Vivendi SE 24/11/2023                                  | 1 083 456        | 0,06              |
| 1 400 000 0.875% Vivendi SE 18/09/2024                                  | 1 340 626        | 0,08              |
| 1 100 000 0.625% Vivendi SE 11/06/2025                                  | 1 029 259        | 0,06              |
| 600 000 1.750% Vodafone Group PLC 25/08/2023                            | 595 968          | 0,03              |
| 1 300 000 0.500% Vodafone Group PLC 30/01/2024                          | 1 270 087        | 0,07              |
| 1 800 000 1.875% Vodafone Group PLC 11/09/2025                          | 1 737 753        | 0,10              |
| 1 400 000 1.125% Vodafone Group PLC 20/11/2025                          | 1 318 982        | 0,07              |
| 900 000 0.875% Volksbank Wien AG 23/03/2026                             | 801 000          | 0,04              |
| 2 095 000 0.750% Volkswagen Bank GmbH 15/06/2023                        | 2 084 734        | 0,12              |
| 1 700 000 1.875% Volkswagen Bank GmbH 31/01/2024                        | 1 672 698        | 0,09              |
| 1 800 000 1.250% Volkswagen Bank GmbH 10/06/2024                        | 1 746 756        | 0,10              |

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 500 000 1.250% Volkswagen Bank GmbH 15/12/2025                          | 468 415          | 0,03              |
| 1 270 000 2.500% Volkswagen Financial Services AG 06/04/2023            | 1 269 632        | 0,07              |
| 1 700 000 0.875% Volkswagen Financial Services AG 12/04/2023            | 1 698 861        | 0,10              |
| 1 200 000 1.375% Volkswagen Financial Services AG 16/10/2023            | 1 187 448        | 0,07              |
| 1 650 000 1.500% Volkswagen Financial Services AG 01/10/2024            | 1 602 628        | 0,09              |
| 1 600 000 0.250% Volkswagen Financial Services AG 31/01/2025            | 1 504 592        | 0,08              |
| 300 000 0.000% Volkswagen Financial Services AG 12/02/2025              | 280 506          | 0,02              |
| 1 100 000 3.000% Volkswagen Financial Services AG 06/04/2025            | 1 088 945        | 0,06              |
| 2 400 000 1.125% Volkswagen International Finance NV 02/10/2023         | 2 372 976        | 0,13              |
| 1 000 000 0.050% Volkswagen International Finance NV 10/06/2024         | 958 970          | 0,05              |
| 1 800 000 3.125% Volkswagen International Finance NV 28/03/2025         | 1 776 114        | 0,10              |
| 2 400 000 4.125% Volkswagen International Finance NV 15/11/2025         | 2 414 520        | 0,14              |
| 1 700 000 3.875% Volkswagen International Finance NV 29/03/2026         | 1 697 276        | 0,10              |
| 2 000 000 4.625% Volkswagen International Finance NV (Perpetual)        | 1 931 400        | 0,11              |
| 1 250 000 5.125% Volkswagen International Finance NV (Perpetual)        | 1 245 375        | 0,07              |
| 2 200 000 3.375% Volkswagen International Finance NV (Perpetual)        | 2 122 890        | 0,12              |
| 2 600 000 3.500% Volkswagen International Finance NV (Perpetual)        | 2 451 826        | 0,14              |
| 1 500 000 0.000% Volkswagen Leasing GmbH 12/07/2023                     | 1 487 685        | 0,08              |
| 2 200 000 2.625% Volkswagen Leasing GmbH 15/01/2024                     | 2 184 754        | 0,12              |
| 2 668 000 1.125% Volkswagen Leasing GmbH 04/04/2024                     | 2 603 781        | 0,15              |
| 2 005 000 0.000% Volkswagen Leasing GmbH 19/07/2024                     | 1 913 351        | 0,11              |
| 2 000 000 1.375% Volkswagen Leasing GmbH 20/01/2025                     | 1 919 400        | 0,11              |
| 1 200 000 1.625% Volkswagen Leasing GmbH 15/08/2025                     | 1 149 108        | 0,06              |
| 900 000 0.250% Volkswagen Leasing GmbH 12/01/2026                       | 816 462          | 0,05              |
| 1 000 000 0.000% Volvo Treasury AB 09/05/2024                           | 960 330          | 0,05              |
| 900 000 2.125% Volvo Treasury AB 01/09/2024                             | 882 090          | 0,05              |
| 800 000 0.125% Volvo Treasury AB 17/09/2024                             | 761 136          | 0,04              |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 800 000 0.625% Volvo Treasury AB 14/02/2025                             | 759 456          | 0,04              |
| 200 000 1.625% Volvo Treasury AB 26/05/2025                             | 192 062          | 0,01              |
| 1 300 000 1.625% Volvo Treasury AB 18/09/2025                           | 1 242 436        | 0,07              |
| 1 200 000 3.500% Volvo Treasury AB 17/11/2025                           | 1 199 136        | 0,07              |
| 1 500 000 2.625% Volvo Treasury AB 20/02/2026                           | 1 465 980        | 0,08              |
| 600 000 0.875% Vonovia Finance BV 03/07/2023                            | 593 658          | 0,03              |
| 1 600 000 2.250% Vonovia Finance BV 15/12/2023                          | 1 577 632        | 0,09              |
| 700 000 0.750% Vonovia Finance BV 15/01/2024                            | 679 616          | 0,04              |
| 1 800 000 1.625% Vonovia Finance BV 07/04/2024                          | 1 746 792        | 0,10              |
| 1 500 000 1.250% Vonovia Finance BV 06/12/2024                          | 1 422 540        | 0,08              |
| 1 000 000 1.500% Vonovia Finance BV 31/03/2025                          | 942 920          | 0,05              |
| 900 000 1.125% Vonovia Finance BV 08/09/2025                            | 826 677          | 0,05              |
| 1 200 000 1.500% Vonovia Finance BV 22/03/2026                          | 1 084 794        | 0,06              |
| 2 500 000 0.000% Vonovia SE 01/12/2025                                  | 2 202 950        | 0,12              |
| 1 700 000 1.375% Vonovia SE 28/01/2026                                  | 1 539 418        | 0,09              |
| 1 860 000 2.250% Wells Fargo & Co 02/05/2023                            | 1 858 382        | 0,10              |
| 2 150 000 0.500% Wells Fargo & Co 26/04/2024                            | 2 077 330        | 0,12              |
| 1 500 000 2.125% Wells Fargo & Co 04/06/2024                            | 1 469 985        | 0,08              |
| 2 700 000 1.338% Wells Fargo & Co 04/05/2025                            | 2 617 596        | 0,15              |
| 2 200 000 1.625% Wells Fargo & Co 02/06/2025                            | 2 094 818        | 0,12              |
| 1 000 000 0.750% Westpac Banking Corp 17/10/2023                        | 984 590          | 0,06              |
| 800 000 0.625% Westpac Banking Corp 22/11/2024                          | 758 904          | 0,04              |
| 2 400 000 3.703% Westpac Banking Corp 16/01/2026                        | 2 392 248        | 0,13              |
| 800 000 0.300% Westpac Securities NZ Ltd/ London 25/06/2024             | 767 024          | 0,04              |
| 1 300 000 1.099% Westpac Securities NZ Ltd/ London 24/03/2026           | 1 198 553        | 0,07              |
| 700 000 2.750% Wienerberger AG 04/06/2025                               | 682 854          | 0,04              |
| 1 500 000 0.452% Wintershall Dea Finance BV 25/09/2023                  | 1 473 840        | 0,08              |
| 1 800 000 0.840% Wintershall Dea Finance BV 25/09/2025                  | 1 662 192        | 0,09              |
| 700 000 2.500% Wolters Kluwer NV 13/05/2024                             | 691 971          | 0,04              |
| 800 000 0.500% Worldline SA/France 30/06/2023                           | 793 856          | 0,04              |
| 800 000 0.250% Worldline SA/France 18/09/2024                           | 759 704          | 0,04              |
| 700 000 2.250% WPC Eurobond BV 19/07/2024                               | 675 654          | 0,04              |
| 1 353 000 3.000% WPP Finance 2013 20/11/2023                            | 1 348 210        | 0,08              |
| 1 300 000 1.375% WPP Finance 2016 20/03/2025                            | 1 238 562        | 0,07              |
| 800 000 1.000% Wurth Finance International BV 26/05/2025                | 764 808          | 0,04              |

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR        | % des actifs nets |
|---|-------------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>                   |                         |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,11 % (mars 2022 : 99,38 %) (suite)</b>             |                         |                   |
| <b>Euro – 99,11 % (suite)</b>   |                         |                   |
| 500 000 0.625% Yorkshire Building Society 21/09/2025                                | 458 770                 | 0,03              |
| <b>Total des obligations d'entreprise</b>   | <b>1 770 314 654</b>    | <b>99,11</b>      |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>   | <b>1 770 314 654</b>    | <b>99,11</b>      |
|   | <b>Juste valeur EUR</b> | <b>% du Comp.</b> |
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | 1 770 314 654           | 99,11             |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,27 %)</b>                               | 46 638 921              | 2,61              |
| <b>Autres passifs nets (mars 2022 : 0,35 %)</b>                                     | (30 720 711)            | (1,72)            |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>1 786 232 864</b>    | <b>100,00</b>     |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

|  | % du total des actifs |
|--|-----------------------|
| <b>Analyse du total des actifs (non audité)</b>                                    |                       |
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs            | 93,91                 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé                        | 0,59                  |
| Autres valeurs mobilières du type mentionné dans le Règlement 68(1)(a), (b) et (c) | 0,58                  |
| Autres actifs  | 4,92                  |
| <b>Total des actifs</b>  | <b>100,00</b>         |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD        | 2022<br>USD        |
|---|-------|--------------------|--------------------|
| <b>Actifs circulants</b>  |       |                    |                    |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :            |       |                    |                    |
| Valeurs mobilières  | 1(e)  | 180 049 411        | 124 185 310        |
|   |       | <b>180 049 411</b> | <b>124 185 310</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie   | 1(f)  | 170 316            | 551 670            |
| Créances :  |       |                    |                    |
| Intérêts à recevoir   |       | 1 500 632          | 857 324            |
| À recevoir sur cessions d'investissements   |       | -                  | 491 822            |
| <b>Total des actifs circulants</b>  |       | <b>181 720 359</b> | <b>126 086 126</b> |
| <b>Passifs circulants</b>   |       |                    |                    |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :  |       |                    |                    |
| Charges à payer   |       | (18 799)           | (12 719)           |
| À payer sur achats d'investissements  |       | -                  | (991 033)          |
| <b>Total des passifs circulants</b>   |       | <b>(18 799)</b>    | <b>(1 003 752)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> |       | <b>181 701 560</b> | <b>125 082 374</b> |
|   |       | <b>2023</b>        | <b>2022</b>        |
|   |       | <b>2021</b>        |                    |
| Valeur liquidative par action   | 5     | 48,51 USD          | 49,05 USD          |
|   |       |                    | 50,70 USD          |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD        | 2022<br>USD        |
|---|-------|--------------------|--------------------|
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 4 467 319          | 1 508 751          |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 9     | (1 640 203)        | (4 075 774)        |
| Produits divers   |       | 16 157             | -                  |
| <b>Total des produits/(charges) d'investissement</b>  |       | <b>2 843 273</b>   | <b>(2 567 023)</b> |
| Charges opérationnelles   | 3     | (196 401)          | (141 690)          |
| <b>Bénéfice/(Perte) net(te) pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>                               |       | <b>2 646 872</b>   | <b>(2 708 713)</b> |
| <b>Charges financières</b>  |       |                    |                    |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables   | 7     | (3 689 063)        | (1 648 690)        |
| <b>Perte pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(1 042 191)</b> | <b>(4 357 403)</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement   | 2     | (494)              | (520)              |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(1 042 685)</b> | <b>(4 357 923)</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>USD        | 2022<br>USD        |
|---|--------------------|--------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier               | 125 082 374        | 72 507 032         |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(1 042 685)</b> | <b>(4 357 923)</b> |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                    |                    |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 132 273 035        | 80 132 027         |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (74 611 164)       | (23 198 762)       |
| Augmentation des actifs nets résultant d'opérations sur actions   | 57 661 871         | 56 933 265         |
| <b>Augmentation totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                 | <b>56 619 186</b>  | <b>52 575 342</b>  |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>        | <b>181 701 560</b> | <b>125 082 374</b> |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.



## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD         | 2022<br>USD         |
|---|-------|---------------------|---------------------|
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(1 042 685)</b>  | <b>(4 357 923)</b>  |
| <b>Ajustement pour :</b>  |       |                     |                     |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  |       | (56 363 312)        | (52 226 564)        |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   |       | <b>(57 405 997)</b> | <b>(56 584 487)</b> |
| Variation des montants à recevoir   |       | (643 308)           | (360 299)           |
| Variation des montants à payer  |       | 6 080               | 6 105               |
| <b>Sorties de trésorerie sur opérations</b>   |       | <b>(637 228)</b>    | <b>(354 194)</b>    |
| <b>Sorties de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  |       | <b>(58 043 225)</b> | <b>(56 938 681)</b> |
| <b>Activités de financement</b>   |       |                     |                     |
| Produits des souscriptions  | 5     | 132 273 035         | 80 132 027          |
| Paiements sur rachats   | 5     | (74 611 164)        | (23 198 762)        |
| <b>Trésorerie nette générée sur activités de financement</b>  |       | <b>57 661 871</b>   | <b>56 933 265</b>   |
| <b>Diminution nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>   |       | <b>(381 354)</b>    | <b>(5 416)</b>      |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  |       | 551 670             | 557 086             |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   |       | <b>170 316</b>      | <b>551 670</b>      |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |       |                     |                     |
| Impôts payés  |       | (494)               | (520)               |
| Intérêts reçus  |       | 4 199 886           | 2 989 950           |
| Distributions payées  |       | (3 689 063)         | (1 648 690)         |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                    | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %)</b>                           |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %)</b>                     |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 %</b>   |                  |                   | <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                       |                  |                   |
| 75 000 3.250% 3M Co 14/02/2024  | 74 083           | 0,04              | 50 000 3.150% Allstate Corp 15/06/2023                          | 49 764           | 0,03              |
| 120 000 2.000% 3M Co 14/02/2025   | 114 376          | 0,06              | 120 000 5.750% Allstate Corp 15/08/2053                         | 116 782          | 0,06              |
| 100 000 2.650% 3M Co 15/04/2025   | 95 792           | 0,05              | 160 000 1.450% Ally Financial Inc 02/10/2023                    | 153 573          | 0,08              |
| 100 000 3.400% Abbott Laboratories 30/11/2023                                       | 98 811           | 0,05              | 100 000 3.875% Ally Financial Inc 21/05/2024                    | 95 540           | 0,05              |
| 110 000 2.950% Abbott Laboratories 15/03/2025                                       | 107 499          | 0,06              | 50 000 5.125% Ally Financial Inc 30/09/2024                     | 48 195           | 0,03              |
| 110 000 2.850% AbbVie Inc 14/05/2023  | 109 668          | 0,06              | 160 000 5.800% Ally Financial Inc 01/05/2025                    | 154 616          | 0,09              |
| 100 000 3.750% AbbVie Inc 14/11/2023  | 99 025           | 0,05              | 50 000 3.375% Alphabet Inc 25/02/2024                           | 49 691           | 0,03              |
| 100 000 3.850% AbbVie Inc 15/06/2024  | 98 783           | 0,05              | 150 000 0.450% Alphabet Inc 15/08/2025                          | 137 748          | 0,08              |
| 350 000 2.600% AbbVie Inc 21/11/2024  | 337 760          | 0,19              | 50 000 4.000% Altria Group Inc 31/01/2024                       | 49 466           | 0,03              |
| 310 000 3.800% AbbVie Inc 15/03/2025  | 305 000          | 0,17              | 150 000 2.350% Altria Group Inc 06/05/2025                      | 142 464          | 0,08              |
| 510 000 3.600% AbbVie Inc 14/05/2025  | 500 295          | 0,28              | 150 000 0.250% Amazon.com Inc 12/05/2023                        | 149 316          | 0,08              |
| 50 000 1.900% Adobe Inc 01/02/2025  | 47 847           | 0,03              | 55 000 0.400% Amazon.com Inc 03/06/2023                         | 54 586           | 0,03              |
| 130 000 3.250% Adobe Inc 01/02/2025   | 127 405          | 0,07              | 50 000 2.730% Amazon.com Inc 13/04/2024                         | 49 017           | 0,03              |
| 100 000 4.500% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 15/09/2023 | 98 955           | 0,05              | 200 000 0.450% Amazon.com Inc 12/05/2024                        | 191 698          | 0,11              |
| 100 000 4.875% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 16/01/2024 | 98 829           | 0,05              | 260 000 2.800% Amazon.com Inc 22/08/2024                        | 254 389          | 0,14              |
| 120 000 3.150% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 15/02/2024 | 116 938          | 0,06              | 140 000 4.700% Amazon.com Inc 29/11/2024                        | 140 976          | 0,08              |
| 100 000 2.875% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 14/08/2024 | 95 547           | 0,05              | 100 000 3.800% Amazon.com Inc 05/12/2024                        | 99 198           | 0,05              |
| 350 000 1.650% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 29/10/2024 | 326 844          | 0,18              | 300 000 3.000% Amazon.com Inc 13/04/2025                        | 292 536          | 0,16              |
| 199 000 1.750% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 29/10/2024 | 185 558          | 0,10              | 220 000 0.800% Amazon.com Inc 03/06/2025                        | 204 684          | 0,11              |
| 122 000 3.500% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 15/01/2025 | 116 941          | 0,06              | 200 000 4.600% Amazon.com Inc 01/12/2025                        | 201 716          | 0,11              |
| 260 000 6.500% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 15/07/2025 | 261 347          | 0,14              | 30 000 4.000% Amcor Flexibles North America Inc 17/05/2025      | 29 385           | 0,02              |
| 100 000 1.750% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 30/01/2026 | 89 311           | 0,05              | 100 000 2.500% Ameren Corp 15/09/2024                           | 96 001           | 0,05              |
| 100 000 2.800% Aetna Inc 15/06/2023   | 99 535           | 0,05              | 30 000 0.750% American Electric Power Co Inc 01/11/2023         | 29 294           | 0,02              |
| 150 000 3.500% Aetna Inc 15/11/2024   | 146 565          | 0,08              | 100 000 2.031% American Electric Power Co Inc 15/03/2024        | 96 976           | 0,05              |
| 110 000 3.000% Air Lease Corp 15/09/2023  | 108 541          | 0,06              | 70 000 3.700% American Express Co 03/08/2023                    | 69 572           | 0,04              |
| 70 000 4.250% Air Lease Corp 01/02/2024   | 68 858           | 0,04              | 70 000 0.750% American Express Co 03/11/2023                    | 68 065           | 0,04              |
| 60 000 0.700% Air Lease Corp 15/02/2024   | 57 274           | 0,03              | 270 000 3.375% American Express Co 03/05/2024                   | 264 759          | 0,15              |
| 150 000 0.800% Air Lease Corp 18/08/2024  | 139 954          | 0,08              | 290 000 2.500% American Express Co 30/07/2024                   | 280 424          | 0,15              |
| 150 000 4.250% Air Lease Corp 15/09/2024  | 147 232          | 0,08              | 150 000 3.000% American Express Co 30/10/2024                   | 146 292          | 0,08              |
| 100 000 3.375% Air Lease Corp 01/07/2025  | 95 074           | 0,05              | 100 000 3.625% American Express Co 05/12/2024                   | 97 572           | 0,05              |
| 100 000 2.875% Air Lease Corp 15/01/2026  | 93 229           | 0,05              | 170 000 2.250% American Express Co 04/03/2025                   | 162 258          | 0,09              |
| 100 000 1.500% Air Products and Chemicals Inc 15/10/2025                            | 92 974           | 0,05              | 360 000 3.950% American Express Co 01/08/2025                   | 353 192          | 0,19              |
| 120 000 5.000% Aircastle Ltd 01/04/2023   | 120 000          | 0,07              | 60 000 4.900% American Express Co 13/02/2026                    | 60 474           | 0,03              |
| 100 000 4.125% Aircastle Ltd 01/05/2024   | 97 749           | 0,05              | 50 000 0.350% American Honda Finance Corp 20/04/2023            | 49 886           | 0,03              |
| 50 000 2.800% Alibaba Group Holding Ltd 06/06/2023                                  | 49 804           | 0,03              | 180 000 1.950% American Honda Finance Corp 10/05/2023           | 179 455          | 0,10              |
| 250 000 3.600% Alibaba Group Holding Ltd 28/11/2024                                 | 244 477          | 0,13              | 115 000 0.875% American Honda Finance Corp 07/07/2023           | 113 709          | 0,06              |
|   |                  |                   | 100 000 3.550% American Honda Finance Corp 12/01/2024           | 98 950           | 0,05              |
|   |                  |                   | 50 000 2.900% American Honda Finance Corp 16/02/2024            | 49 078           | 0,03              |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>                     |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>               |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 50 000 2.400% American Honda Finance Corp 27/06/2024                                  | 48 534           | 0,03              |
| 130 000 0.550% American Honda Finance Corp 12/07/2024                                 | 123 254          | 0,07              |
| 100 000 0.750% American Honda Finance Corp 09/08/2024                                 | 94 782           | 0,05              |
| 110 000 2.150% American Honda Finance Corp 10/09/2024                                 | 106 054          | 0,06              |
| 260 000 1.500% American Honda Finance Corp 13/01/2025                                 | 246 160          | 0,14              |
| 100 000 4.750% American Honda Finance Corp 12/01/2026                                 | 100 795          | 0,06              |
| 127 000 2.500% American International Group Inc 30/06/2025                            | 120 235          | 0,07              |
| 80 000 3.000% American Tower Corp 15/06/2023  | 79 587           | 0,04              |
| 170 000 0.600% American Tower Corp 15/01/2024   | 163 788          | 0,09              |
| 130 000 5.000% American Tower Corp 15/02/2024   | 129 542          | 0,07              |
| 50 000 3.375% American Tower Corp 15/05/2024  | 48 938           | 0,03              |
| 100 000 2.400% American Tower Corp 15/03/2025   | 94 861           | 0,05              |
| 100 000 1.300% American Tower Corp 15/09/2025   | 91 698           | 0,05              |
| 50 000 3.850% American Water Capital Corp 01/03/2024                                  | 49 290           | 0,03              |
| 80 000 3.400% American Water Capital Corp 01/03/2025                                  | 77 994           | 0,04              |
| 50 000 4.000% Ameriprise Financial Inc 15/10/2023                                     | 49 609           | 0,03              |
| 50 000 3.700% Ameriprise Financial Inc 15/10/2024                                     | 48 940           | 0,03              |
| 100 000 3.000% Ameriprise Financial Inc 02/04/2025                                    | 96 338           | 0,05              |
| 30 000 3.400% AmerisourceBergen Corp 15/05/2024                                       | 29 431           | 0,02              |
| 125 000 2.250% Amgen Inc 19/08/2023   | 123 456          | 0,07              |
| 150 000 3.625% Amgen Inc 22/05/2024   | 147 895          | 0,08              |
| 50 000 1.900% Amgen Inc 21/02/2025  | 47 526           | 0,03              |
| 200 000 5.250% Amgen Inc 02/03/2025   | 202 230          | 0,11              |
| 100 000 3.125% Amgen Inc 01/05/2025   | 97 071           | 0,05              |
| 170 000 2.950% Analog Devices Inc 01/04/2025  | 164 347          | 0,09              |
| 400 000 3.650% Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 01/02/2026 | 392 548          | 0,22              |
| 30 000 4.000% Aon Global Ltd 27/11/2023   | 29 654           | 0,02              |
| 100 000 3.500% Aon Global Ltd 14/06/2024  | 98 157           | 0,05              |
| 50 000 3.400% Appalachian Power Co 01/06/2025   | 48 436           | 0,03              |
| 525 000 2.400% Apple Inc 03/05/2023   | 523 981          | 0,29              |
| 375 000 0.750% Apple Inc 11/05/2023   | 373 466          | 0,21              |
| 70 000 3.000% Apple Inc 09/02/2024  | 69 184           | 0,04              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>               |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>         |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                                       |                  |                   |
| 300 000 3.450% Apple Inc 06/05/2024   | 296 562          | 0,16              |
| 300 000 2.850% Apple Inc 11/05/2024   | 294 936          | 0,16              |
| 350 000 2.750% Apple Inc 13/01/2025   | 341 050          | 0,19              |
| 100 000 2.500% Apple Inc 09/02/2025   | 97 015           | 0,05              |
| 280 000 1.125% Apple Inc 11/05/2025   | 262 738          | 0,14              |
| 400 000 3.200% Apple Inc 13/05/2025   | 392 436          | 0,22              |
| 100 000 0.550% Apple Inc 20/08/2025   | 92 166           | 0,05              |
| 200 000 0.700% Apple Inc 08/02/2026   | 181 958          | 0,10              |
| 100 000 3.250% Apple Inc 23/02/2026   | 97 857           | 0,05              |
| 100 000 3.900% Applied Materials Inc 01/10/2025                                 | 98 666           | 0,05              |
| 154 000 2.396% Aptiv PLC / Aptiv Corp 18/02/2025                                | 146 616          | 0,08              |
| 100 000 4.250% Ares Capital Corp 01/03/2025                                     | 94 569           | 0,05              |
| 270 000 3.250% Ares Capital Corp 15/07/2025                                     | 247 533          | 0,14              |
| 50 000 3.250% Arrow Electronics Inc 08/09/2024                                  | 48 605           | 0,03              |
| 70 000 4.650% Aspen Insurance Holdings Ltd 15/11/2023                           | 69 453           | 0,04              |
| 50 000 5.000% Assured Guaranty US Holdings Inc 01/07/2024                       | 49 722           | 0,03              |
| 200 000 0.700% Astrazeneca Finance LLC 28/05/2024                               | 191 226          | 0,11              |
| 100 000 0.300% AstraZeneca PLC 26/05/2023                                       | 99 277           | 0,05              |
| 80 000 3.500% AstraZeneca PLC 17/08/2023  | 79 414           | 0,04              |
| 280 000 3.375% AstraZeneca PLC 16/11/2025                                       | 274 501          | 0,15              |
| 410 000 0.900% AT&T Inc 25/03/2024  | 392 382          | 0,22              |
| 210 000 1.700% AT&T Inc 25/03/2026  | 192 744          | 0,11              |
| 100 000 3.700% Australia & New Zealand Banking Group Ltd/New York NY 16/11/2025 | 97 527           | 0,05              |
| 100 000 5.088% Australia & New Zealand Banking Group Ltd/New York NY 08/12/2025 | 100 871          | 0,06              |
| 100 000 3.375% Automatic Data Processing Inc 15/09/2025                         | 98 096           | 0,05              |
| 100 000 4.500% AutoNation Inc 01/10/2025  | 97 570           | 0,05              |
| 40 000 3.125% AutoZone Inc 15/07/2023   | 39 730           | 0,02              |
| 150 000 3.625% AutoZone Inc 15/04/2025  | 146 226          | 0,08              |
| 100 000 4.200% AvalonBay Communities Inc 15/12/2023                             | 99 205           | 0,05              |
| 100 000 3.450% AvalonBay Communities Inc 01/06/2025                             | 96 537           | 0,05              |
| 140 000 3.200% Avangrid Inc 15/04/2025  | 134 236          | 0,07              |
| 70 000 0.850% Avery Dennison Corp 15/08/2024                                    | 66 135           | 0,04              |
| 140 000 3.875% Baidu Inc 29/09/2023   | 139 111          | 0,08              |
| 100 000 4.375% Baidu Inc 14/05/2024   | 99 241           | 0,05              |
| 160 000 3.350% Baltimore Gas and Electric Co 01/07/2023                         | 159 118          | 0,09              |
| 100 000 0.875% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 18/09/2023                    | 97 757           | 0,05              |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD                                     | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets                              |         |      |
|---|--|-------------------|---|------------------|--|---------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |  |         |      |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |  |         |      |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |  |                   | <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |  |         |      |
| 200 000   | 1.125% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 18/09/2025 | 180 874           | 0,10  | 200 000          | 4.250% Bank of Montreal 14/09/2024             | 197 514 | 0,11 |
| 100 000   | 5.862% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 14/09/2026 | 98 793            | 0,05  | 185 000          | 1.500% Bank of Montreal 10/01/2025             | 173 967 | 0,10 |
| 100 000   | 0.000% Banco Santander SA 12/04/2023                 | 99 961            | 0,06  | 260 000          | 1.850% Bank of Montreal 01/05/2025             | 243 620 | 0,13 |
| 200 000   | 3.892% Banco Santander SA 24/05/2024                 | 195 866           | 0,11  | 270 000          | 3.700% Bank of Montreal 07/06/2025             | 262 472 | 0,14 |
| 200 000   | 2.706% Banco Santander SA 27/06/2024                 | 193 192           | 0,11  | 200 000          | 0.949% Bank of Montreal 22/01/2027             | 178 656 | 0,10 |
| 150 000   | 0.701% Banco Santander SA 30/06/2024                 | 147 897           | 0,08  | 90 000           | 4.338% Bank of Montreal 05/10/2028             | 88 814  | 0,05 |
| 200 000   | 3.496% Banco Santander SA 24/03/2025                 | 192 154           | 0,11  | 180 000          | 3.450% Bank of New York Mellon Corp 11/08/2023 | 178 762 | 0,10 |
| 200 000   | 2.746% Banco Santander SA 28/05/2025                 | 188 192           | 0,10  | 100 000          | 2.200% Bank of New York Mellon Corp 16/08/2023 | 98 957  | 0,05 |
| 100 000   | 5.179% Banco Santander SA 19/11/2025                 | 98 009            | 0,05  | 210 000          | 0.350% Bank of New York Mellon Corp 07/12/2023 | 202 761 | 0,11 |
| 200 000   | 1.849% Banco Santander SA 25/03/2026                 | 179 126           | 0,10  | 160 000          | 0.500% Bank of New York Mellon Corp 26/04/2024 | 152 250 | 0,08 |
| 290 000   | 4.100% Bank of America Corp 24/07/2023               | 288 796           | 0,16  | 190 000          | 2.100% Bank of New York Mellon Corp 24/10/2024 | 181 872 | 0,10 |
| 150 000   | 4.125% Bank of America Corp 22/01/2024               | 149 046           | 0,08  | 150 000          | 1.600% Bank of New York Mellon Corp 24/04/2025 | 139 933 | 0,08 |
| 320 000   | 4.000% Bank of America Corp 01/04/2024               | 316 256           | 0,17  | 100 000          | 3.350% Bank of New York Mellon Corp 25/04/2025 | 96 759  | 0,05 |
| 80 000  | 0.523% Bank of America Corp 14/06/2024               | 79 130            | 0,04  | 210 000          | 3.430% Bank of New York Mellon Corp 13/06/2025 | 205 540 | 0,11 |
| 300 000   | 3.864% Bank of America Corp 23/07/2024               | 298 227           | 0,16  | 200 000          | 4.414% Bank of New York Mellon Corp 24/07/2026 | 197 778 | 0,11 |
| 220 000   | 4.200% Bank of America Corp 26/08/2024               | 216 478           | 0,12  | 240 000          | 1.625% Bank of Nova Scotia 01/05/2023          | 239 239 | 0,13 |
| 300 000   | 0.810% Bank of America Corp 24/10/2024               | 291 624           | 0,16  | 50 000           | 0.550% Bank of Nova Scotia 15/09/2023          | 48 919  | 0,03 |
| 340 000   | 4.000% Bank of America Corp 22/01/2025               | 332 921           | 0,18  | 100 000          | 3.400% Bank of Nova Scotia 11/02/2024          | 98 170  | 0,05 |
| 110 000   | 1.843% Bank of America Corp 04/02/2025               | 106 699           | 0,06  | 60 000           | 2.440% Bank of Nova Scotia 11/03/2024          | 58 348  | 0,03 |
| 260 000   | 3.458% Bank of America Corp 15/03/2025               | 254 530           | 0,14  | 250 000          | 0.700% Bank of Nova Scotia 15/04/2024          | 238 925 | 0,13 |
| 350 000   | 3.950% Bank of America Corp 21/04/2025               | 339 178           | 0,19  | 200 000          | 0.650% Bank of Nova Scotia 31/07/2024          | 188 628 | 0,10 |
| 220 000   | 0.976% Bank of America Corp 22/04/2025               | 209 605           | 0,12  | 100 000          | 5.250% Bank of Nova Scotia 06/12/2024          | 100 232 | 0,06 |
| 170 000   | 3.841% Bank of America Corp 25/04/2025               | 166 843           | 0,09  | 240 000          | 1.450% Bank of Nova Scotia 10/01/2025          | 225 089 | 0,12 |
| 50 000  | 3.875% Bank of America Corp 01/08/2025               | 48 883            | 0,03  | 200 000          | 2.200% Bank of Nova Scotia 03/02/2025          | 190 134 | 0,10 |
| 210 000   | 0.981% Bank of America Corp 25/09/2025               | 196 125           | 0,11  | 300 000          | 3.450% Bank of Nova Scotia 11/04/2025          | 290 985 | 0,16 |
| 320 000   | 3.093% Bank of America Corp 01/10/2025               | 308 144           | 0,17  | 100 000          | 4.500% Bank of Nova Scotia 16/12/2025          | 98 004  | 0,05 |
| 300 000   | 2.456% Bank of America Corp 22/10/2025               | 285 783           | 0,16  | 100 000          | 3.750% Barclays Bank PLC 15/05/2024            | 97 847  | 0,05 |
| 200 000   | 1.530% Bank of America Corp 06/12/2025               | 187 386           | 0,10  | 100 000          | 4.338% Barclays PLC 16/05/2024                 | 99 777  | 0,05 |
| 400 000   | 3.366% Bank of America Corp 23/01/2026               | 384 748           | 0,21  | 200 000          | 4.375% Barclays PLC 11/09/2024                 | 192 826 | 0,11 |
| 120 000   | 2.015% Bank of America Corp 13/02/2026               | 112 496           | 0,06  | 210 000          | 1.007% Barclays PLC 10/12/2024                 | 202 543 | 0,11 |
| 80 000  | 4.450% Bank of America Corp 03/03/2026               | 78 337            | 0,04  | 250 000          | 3.650% Barclays PLC 16/03/2025                 | 238 532 | 0,13 |
| 230 000   | 3.384% Bank of America Corp 02/04/2026               | 220 724           | 0,12  | 200 000          | 3.932% Barclays PLC 07/05/2025                 | 194 618 | 0,11 |
| 240 000   | 1.319% Bank of America Corp 19/06/2026               | 219 360           | 0,12  | 200 000          | 4.375% Barclays PLC 12/01/2026                 | 193 662 | 0,11 |
| 70 000  | 4.827% Bank of America Corp 22/07/2026               | 69 162            | 0,04  | 210 000          | 2.852% Barclays PLC 07/05/2026                 | 196 234 | 0,11 |
| 400 000   | 1.197% Bank of America Corp 24/10/2026               | 359 392           | 0,20  | 100 000          | 5.304% Barclays PLC 09/08/2026                 | 98 029  | 0,05 |
| 400 000   | 5.080% Bank of America Corp 20/01/2027               | 399 132           | 0,22  | 200 000          | 7.325% Barclays PLC 02/11/2026                 | 205 678 | 0,11 |
| 180 000   | 1.658% Bank of America Corp 11/03/2027               | 162 841           | 0,09  | 290 000          | 3.222% BAT Capital Corp 15/08/2024             | 281 544 | 0,16 |
| 100 000   | 0.400% Bank of Montreal 15/09/2023                   | 97 691            | 0,05  |                  |  |         |      |
| 100 000   | 3.300% Bank of Montreal 05/02/2024                   | 98 239            | 0,05  |                  |  |         |      |
| 180 000   | 2.150% Bank of Montreal 08/03/2024                   | 174 683           | 0,10  |                  |  |         |      |
| 100 000   | 2.500% Bank of Montreal 28/06/2024                   | 96 698            | 0,05  |                  |  |         |      |
| 100 000   | 0.625% Bank of Montreal 09/07/2024                   | 94 513            | 0,05  |                  |  |         |      |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 110 000 2.789% BAT Capital Corp 06/09/2024                              | 106 056          | 0,06              | 70 000 3.800% Boston Properties LP 01/02/2024                           | 67 692           | 0,04              |
| 100 000 4.000% Baxalta Inc 23/06/2025                                   | 97 900           | 0,05              | 100 000 3.200% Boston Properties LP 15/01/2025                          | 92 822           | 0,05              |
| 50 000 0.868% Baxter International Inc 01/12/2023                       | 48 549           | 0,03              | 50 000 3.450% Boston Scientific Corp 01/03/2024                         | 49 153           | 0,03              |
| 200 000 1.322% Baxter International Inc 29/11/2024                      | 188 212          | 0,10              | 100 000 3.796% BP Capital Markets America Inc 21/09/2025                | 99 277           | 0,05              |
| 146 000 3.363% Becton Dickinson and Co 06/06/2024                       | 143 315          | 0,08              | 100 000 3.410% BP Capital Markets America Inc 11/02/2026                | 97 418           | 0,05              |
| 50 000 3.734% Becton Dickinson and Co 15/12/2024                        | 48 979           | 0,03              | 350 000 4.000% BPCE SA 15/04/2024                                       | 343 595          | 0,19              |
| 130 000 0.750% Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada 17/03/2024    | 124 240          | 0,07              | 200 000 0.537% Bristol-Myers Squibb Co 13/11/2023                       | 194 518          | 0,11              |
| 160 000 3.750% Berkshire Hathaway Energy Co 15/11/2023                  | 158 536          | 0,09              | 300 000 2.900% Bristol-Myers Squibb Co 26/07/2024                       | 294 168          | 0,16              |
| 230 000 4.050% Berkshire Hathaway Energy Co 15/04/2025                  | 228 882          | 0,13              | 100 000 0.750% Bristol-Myers Squibb Co 13/11/2025                       | 91 554           | 0,05              |
| 180 000 3.125% Berkshire Hathaway Inc 15/03/2026                        | 175 176          | 0,10              | 150 000 4.500% British Telecommunications PLC 04/12/2023                | 149 011          | 0,08              |
| 100 000 1.570% Berry Global Inc 15/01/2026                              | 90 850           | 0,05              | 100 000 3.650% Brixmor Operating Partnership LP 15/06/2024              | 96 921           | 0,05              |
| 60 000 5.375% BGC Partners Inc 24/07/2023                               | 59 759           | 0,03              | 50 000 3.625% Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 15/01/2024    | 49 375           | 0,03              |
| 125 000 3.750% BGC Partners Inc 01/10/2024                              | 119 782          | 0,07              | 100 000 3.625% Broadcom Inc 15/10/2024                                  | 97 400           | 0,05              |
| 130 000 3.850% BHP Billiton Finance USA Ltd 30/09/2023                  | 129 150          | 0,07              | 130 000 3.150% Broadcom Inc 15/11/2025                                  | 124 596          | 0,07              |
| 100 000 6.420% BHP Billiton Finance USA Ltd 01/03/2026                  | 104 625          | 0,06              | 70 000 4.000% Brookfield Corp 15/01/2025                                | 68 704           | 0,04              |
| 250 000 4.050% Biogen Inc 15/09/2025                                    | 244 295          | 0,13              | 130 000 4.000% Brookfield Finance Inc 01/04/2024                        | 127 774          | 0,07              |
| 80 000 1.037% Black Hills Corp 23/08/2024                               | 75 414           | 0,04              | 80 000 0.850% Brunswick Corp/DE 18/08/2024                              | 74 841           | 0,04              |
| 90 000 3.500% BlackRock Inc 18/03/2024                                  | 88 775           | 0,05              | 150 000 1.630% Bunge Ltd Finance Corp 17/08/2025                        | 138 760          | 0,08              |
| 160 000 1.750% Blackstone Private Credit Fund 15/09/2024                | 148 682          | 0,08              | 250 000 3.850% Burlington Northern Santa Fe LLC 01/09/2023              | 248 970          | 0,14              |
| 190 000 2.350% Blackstone Private Credit Fund 22/11/2024                | 176 356          | 0,10              | 100 000 3.400% Burlington Northern Santa Fe LLC 01/09/2024              | 98 216           | 0,05              |
| 50 000 4.700% Blackstone Private Credit Fund 24/03/2025                 | 47 750           | 0,03              | 200 000 3.950% Campbell Soup Co 15/03/2025                              | 196 418          | 0,11              |
| 100 000 3.625% Blackstone Secured Lending Fund 15/01/2026               | 90 776           | 0,05              | 190 000 0.450% Canadian Imperial Bank of Commerce 22/06/2023            | 187 828          | 0,10              |
| 100 000 4.250% BNP Paribas SA 15/10/2024                                | 97 071           | 0,05              | 90 000 0.950% Canadian Imperial Bank of Commerce 23/06/2023             | 89 129           | 0,05              |
| 50 000 4.950% Boardwalk Pipelines LP 15/12/2024                         | 49 694           | 0,03              | 100 000 3.500% Canadian Imperial Bank of Commerce 13/09/2023            | 99 058           | 0,05              |
| 270 000 4.508% Boeing Co 01/05/2023                                     | 269 725          | 0,15              | 50 000 0.500% Canadian Imperial Bank of Commerce 14/12/2023             | 48 430           | 0,03              |
| 90 000 1.950% Boeing Co 01/02/2024                                      | 87 473           | 0,05              | 120 000 3.100% Canadian Imperial Bank of Commerce 02/04/2024            | 117 262          | 0,06              |
| 290 000 1.433% Boeing Co 04/02/2024                                     | 280 291          | 0,15              | 100 000 2.250% Canadian Imperial Bank of Commerce 28/01/2025            | 95 092           | 0,05              |
| 150 000 2.800% Boeing Co 01/03/2024                                     | 146 152          | 0,08              | 290 000 3.300% Canadian Imperial Bank of Commerce 07/04/2025            | 280 624          | 0,15              |
| 60 000 2.850% Boeing Co 30/10/2024                                      | 58 010           | 0,03              | 60 000 3.945% Canadian Imperial Bank of Commerce 04/08/2025             | 58 508           | 0,03              |
| 570 000 4.875% Boeing Co 01/05/2025                                     | 568 877          | 0,31              |   |                  |                   |
| 100 000 2.750% Boeing Co 01/02/2026                                     | 94 742           | 0,05              |   |                  |                   |
| 500 000 2.196% Boeing Co 04/02/2026                                     | 463 805          | 0,26              |   |                  |                   |
| 200 000 3.125% Boston Properties LP 01/09/2023                          | 195 952          | 0,11              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>   |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>                                   |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 30 000 2.950% Canadian National Railway Co 21/11/2024                   | 29 179           | 0,02              | 150 000 3.400% Caterpillar Inc 15/05/2024   | 148 347          | 0,08              |
| 100 000 3.900% Canadian Natural Resources Ltd 01/02/2025                | 97 896           | 0,05              | 50 000 5.500% CDW LLC / CDW Finance Corp 01/12/2024   | 49 916           | 0,03              |
| 50 000 2.050% Canadian Natural Resources Ltd 15/07/2025                 | 46 851           | 0,03              | 130 000 4.125% CDW LLC / CDW Finance Corp 01/05/2025  | 126 902          | 0,07              |
| 215 000 1.350% Canadian Pacific Railway Co 02/12/2024                   | 202 655          | 0,11              | 150 000 3.500% Celanese US Holdings LLC 08/05/2024  | 146 547          | 0,08              |
| 85 000 2.600% Capital One Financial Corp 11/05/2023                     | 84 555           | 0,05              | 120 000 5.900% Celanese US Holdings LLC 05/07/2024  | 120 056          | 0,07              |
| 130 000 3.900% Capital One Financial Corp 29/01/2024                    | 127 578          | 0,07              | 210 000 6.050% Celanese US Holdings LLC 15/03/2025  | 211 216          | 0,12              |
| 70 000 3.750% Capital One Financial Corp 24/04/2024                     | 68 302           | 0,04              | 100 000 4.500% Celulosa Arauco y Constitucion SA 01/08/2024   | 98 162           | 0,05              |
| 270 000 3.300% Capital One Financial Corp 30/10/2024                    | 258 050          | 0,14              | 95 000 0.750% Charles Schwab Corp 18/03/2024  | 90 449           | 0,05              |
| 190 000 1.343% Capital One Financial Corp 06/12/2024                    | 183 259          | 0,10              | 100 000 3.750% Charles Schwab Corp 01/04/2024   | 98 224           | 0,05              |
| 150 000 4.166% Capital One Financial Corp 09/05/2025                    | 145 288          | 0,08              | 100 000 3.000% Charles Schwab Corp 10/03/2025   | 94 968           | 0,05              |
| 300 000 4.200% Capital One Financial Corp 29/10/2025                    | 280 488          | 0,15              | 150 000 4.200% Charles Schwab Corp 24/03/2025   | 146 202          | 0,08              |
| 295 000 4.985% Capital One Financial Corp 24/07/2026                    | 284 235          | 0,16              | 185 000 3.850% Charles Schwab Corp 21/05/2025   | 177 890          | 0,10              |
| 180 000 3.079% Cardinal Health Inc 15/06/2024                           | 175 903          | 0,10              | 200 000 4.500% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 01/02/2024 | 197 914          | 0,11              |
| 150 000 0.550% Carlisle Cos Inc 01/09/2023                              | 146 830          | 0,08              | 500 000 4.908% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 23/07/2025 | 494 490          | 0,27              |
| 140 000 2.242% Carrier Global Corp 15/02/2025                           | 133 644          | 0,07              | 240 000 5.875% Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 31/03/2025  | 241 745          | 0,13              |
| 100 000 0.650% Caterpillar Financial Services Corp 07/07/2023           | 98 849           | 0,05              | 170 000 1.141% Chevron Corp 11/05/2023  | 169 267          | 0,09              |
| 100 000 0.450% Caterpillar Financial Services Corp 14/09/2023           | 97 805           | 0,05              | 300 000 1.554% Chevron Corp 11/05/2025  | 282 960          | 0,16              |
| 50 000 3.650% Caterpillar Financial Services Corp 07/12/2023            | 49 471           | 0,03              | 50 000 0.426% Chevron USA Inc 11/08/2023  | 49 151           | 0,03              |
| 170 000 0.450% Caterpillar Financial Services Corp 17/05/2024           | 162 324          | 0,09              | 100 000 3.900% Chevron USA Inc 15/11/2024   | 99 611           | 0,05              |
| 50 000 2.850% Caterpillar Financial Services Corp 17/05/2024            | 49 013           | 0,03              | 100 000 0.687% Chevron USA Inc 12/08/2025   | 91 739           | 0,05              |
| 100 000 3.300% Caterpillar Financial Services Corp 09/06/2024           | 98 422           | 0,05              | 100 000 3.350% Chubb INA Holdings Inc 15/05/2024  | 98 365           | 0,05              |
| 100 000 0.600% Caterpillar Financial Services Corp 13/09/2024           | 94 620           | 0,05              | 100 000 3.150% Chubb INA Holdings Inc 15/03/2025  | 97 436           | 0,05              |
| 210 000 2.150% Caterpillar Financial Services Corp 08/11/2024           | 202 553          | 0,11              | 25 000 3.000% Cigna Group 15/07/2023  | 24 806           | 0,01              |
| 200 000 4.900% Caterpillar Financial Services Corp 17/01/2025           | 201 466          | 0,11              | 84 000 3.750% Cigna Group 15/07/2023  | 83 583           | 0,05              |
| 150 000 3.400% Caterpillar Financial Services Corp 13/05/2025           | 146 979          | 0,08              | 50 000 0.613% Cigna Group 15/03/2024  | 47 829           | 0,03              |
| 220 000 3.650% Caterpillar Financial Services Corp 12/08/2025           | 216 082          | 0,12              | 250 000 3.250% Cigna Group 15/04/2025   | 242 320          | 0,13              |
| 100 000 0.800% Caterpillar Financial Services Corp 13/11/2025           | 91 299           | 0,05              | 370 000 4.125% Cigna Group 15/11/2025   | 364 298          | 0,20              |
|   |                  |                   | 310 000 1.250% Cigna Group 15/03/2026   | 280 851          | 0,15              |
|   |                  |                   | 80 000 3.450% Cintas Corp No 2 01/05/2025   | 78 143           | 0,04              |
|   |                  |                   | 50 000 2.200% Cisco Systems Inc 20/09/2023  | 49 400           | 0,03              |
|   |                  |                   | 100 000 3.625% Cisco Systems Inc 04/03/2024   | 98 943           | 0,05              |
|   |                  |                   | 150 000 3.650% Citibank NA 23/01/2024   | 147 876          | 0,08              |
|   |                  |                   | 150 000 3.500% Citigroup Inc 15/05/2023   | 149 718          | 0,08              |
|   |                  |                   | 100 000 4.044% Citigroup Inc 01/06/2024   | 99 701           | 0,05              |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 70 000 4.000% Citigroup Inc 05/08/2024                                  | 68 787           | 0,04              |
| 310 000 0.776% Citigroup Inc 30/10/2024                                 | 301 314          | 0,17              |
| 100 000 3.875% Citigroup Inc 26/03/2025                                 | 96 898           | 0,05              |
| 380 000 3.352% Citigroup Inc 24/04/2025                                 | 370 538          | 0,20              |
| 25 000 3.300% Citigroup Inc 27/04/2025                                  | 24 127           | 0,01              |
| 300 000 0.981% Citigroup Inc 01/05/2025                                 | 285 276          | 0,16              |
| 220 000 4.140% Citigroup Inc 24/05/2025                                 | 216 302          | 0,12              |
| 280 000 4.400% Citigroup Inc 10/06/2025                                 | 272 913          | 0,15              |
| 150 000 5.500% Citigroup Inc 13/09/2025                                 | 149 866          | 0,08              |
| 200 000 1.281% Citigroup Inc 03/11/2025                                 | 186 786          | 0,10              |
| 70 000 3.700% Citigroup Inc 12/01/2026                                  | 67 827           | 0,04              |
| 285 000 2.014% Citigroup Inc 25/01/2026                                 | 268 436          | 0,15              |
| 200 000 3.290% Citigroup Inc 17/03/2026                                 | 192 066          | 0,11              |
| 510 000 3.106% Citigroup Inc 08/04/2026                                 | 487 647          | 0,27              |
| 400 000 5.610% Citigroup Inc 29/09/2026                                 | 402 380          | 0,22              |
| 420 000 1.122% Citigroup Inc 28/01/2027                                 | 375 211          | 0,21              |
| 50 000 2.250% Citizens Bank NA/Providence RI 28/04/2025                 | 44 793           | 0,02              |
| 100 000 4.119% Citizens Bank NA/Providence RI 23/05/2025                | 94 159           | 0,05              |
| 100 000 6.064% Citizens Bank NA/Providence RI 24/10/2025                | 94 177           | 0,05              |
| 100 000 5.500% Cleveland Electric Illuminating Co 15/08/2024            | 100 626          | 0,06              |
| 70 000 3.000% CME Group Inc 15/03/2025                                  | 67 826           | 0,04              |
| 100 000 3.950% CNA Financial Corp 15/05/2024                            | 98 658           | 0,05              |
| 80 000 1.950% CNH Industrial Capital LLC 02/07/2023                     | 79 160           | 0,04              |
| 100 000 5.450% CNH Industrial Capital LLC 14/10/2025                    | 101 212          | 0,06              |
| 100 000 4.500% CNH Industrial NV 15/08/2023                             | 99 455           | 0,05              |
| 50 000 5.250% CNO Financial Group Inc 30/05/2025                        | 49 361           | 0,03              |
| 150 000 1.750% Coca-Cola Co 06/09/2024                                  | 145 555          | 0,08              |
| 170 000 3.100% Colgate-Palmolive Co 15/08/2025                          | 165 758          | 0,09              |
| 120 000 4.500% Columbia Pipeline Group Inc 01/06/2025                   | 118 687          | 0,07              |
| 150 000 3.700% Comcast Corp 15/04/2024                                  | 148 260          | 0,08              |
| 290 000 3.375% Comcast Corp 15/02/2025                                  | 284 423          | 0,16              |
| 110 000 3.375% Comcast Corp 15/08/2025                                  | 107 488          | 0,06              |
| 420 000 3.950% Comcast Corp 15/10/2025                                  | 415 237          | 0,23              |
| 30 000 5.250% Comcast Corp 07/11/2025                                   | 30 664           | 0,02              |
| 100 000 3.150% Comcast Corp 01/03/2026                                  | 96 999           | 0,05              |
| 129 000 2.500% Comerica Bank 23/07/2024                                 | 118 465          | 0,07              |
| 125 000 4.000% Comerica Bank 27/07/2025                                 | 102 277          | 0,06              |
| 70 000 3.700% Comerica Inc 31/07/2023                                   | 67 409           | 0,04              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 130 000 2.760% CommonSpirit Health 01/10/2024                           | 125 957          | 0,07              |
| 150 000 5.316% Commonwealth Bank of Australia/New York NY 13/03/2026    | 152 662          | 0,08              |
| 150 000 4.300% Conagra Brands Inc 01/05/2024                            | 148 573          | 0,08              |
| 150 000 4.600% Conagra Brands Inc 01/11/2025                            | 148 602          | 0,08              |
| 120 000 2.125% ConocoPhillips Co 08/03/2024                             | 116 773          | 0,06              |
| 100 000 2.400% ConocoPhillips Co 07/03/2025                             | 95 983           | 0,05              |
| 50 000 0.650% Consolidated Edison Inc 01/12/2023                        | 48 524           | 0,03              |
| 25 000 3.600% Constellation Brands Inc 09/05/2024                       | 24 639           | 0,01              |
| 160 000 4.400% Constellation Brands Inc 15/11/2025                      | 157 902          | 0,09              |
| 120 000 3.250% Constellation Energy Generation LLC 01/06/2025           | 115 808          | 0,06              |
| 65 000 0.350% Consumers Energy Co 01/06/2023                            | 64 447           | 0,04              |
| 50 000 3.800% Continental Resources Inc/OK 01/06/2024                   | 48 977           | 0,03              |
| 50 000 4.625% Cooperatieve Rabobank UA 01/12/2023                       | 49 842           | 0,03              |
| 150 000 4.375% Cooperatieve Rabobank UA 04/08/2025                      | 145 167          | 0,08              |
| 150 000 0.375% Cooperatieve Rabobank UA/NY 12/01/2024                   | 144 093          | 0,08              |
| 184 000 3.875% Cooperatieve Rabobank UA/NY 22/08/2024                   | 181 198          | 0,10              |
| 100 000 1.375% Cooperatieve Rabobank UA/NY 10/01/2025                   | 93 967           | 0,05              |
| 100 000 3.375% Cooperatieve Rabobank UA/NY 21/05/2025                   | 96 373           | 0,05              |
| 150 000 3.500% Corebridge Financial Inc 04/04/2025                      | 144 270          | 0,08              |
| 80 000 2.750% Costco Wholesale Corp 18/05/2024                          | 78 303           | 0,04              |
| 50 000 0.780% Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA 28/06/2024 | 47 264           | 0,03              |
| 170 000 1.000% Credit Suisse AG/New York NY 05/05/2023                  | 168 302          | 0,09              |
| 100 000 0.520% Credit Suisse AG/New York NY 09/08/2023                  | 96 967           | 0,05              |
| 150 000 0.495% Credit Suisse AG/New York NY 02/02/2024                  | 141 477          | 0,08              |
| 240 000 4.750% Credit Suisse AG/New York NY 09/08/2024                  | 231 850          | 0,13              |
| 300 000 3.625% Credit Suisse AG/New York NY 09/09/2024                  | 286 713          | 0,16              |
| 190 000 3.700% Credit Suisse AG/New York NY 21/02/2025                  | 180 352          | 0,10              |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>           |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>     |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                                   |                  |                   |
| 180 000 2.950% Credit Suisse AG/New York NY 09/04/2025                      | 167 247          | 0,09              |
| 200 000 3.800% Credit Suisse Group AG 09/06/2023                            | 195 338          | 0,11              |
| 350 000 3.750% Credit Suisse Group AG 26/03/2025                            | 322 472          | 0,18              |
| 130 000 3.150% Crown Castle Inc 15/07/2023                                  | 129 142          | 0,07              |
| 50 000 3.200% Crown Castle Inc 01/09/2024                                   | 48 616           | 0,03              |
| 50 000 1.350% Crown Castle Inc 15/07/2025                                   | 46 102           | 0,03              |
| 170 000 3.400% CSX Corp 01/08/2024  | 166 328          | 0,09              |
| 100 000 3.375% CVS Health Corp 12/08/2024                                   | 98 040           | 0,05              |
| 280 000 2.625% CVS Health Corp 15/08/2024                                   | 271 888          | 0,15              |
| 60 000 4.100% CVS Health Corp 25/03/2025                                    | 59 585           | 0,03              |
| 312 000 3.875% CVS Health Corp 20/07/2025                                   | 306 403          | 0,17              |
| 120 000 5.375% DCP Midstream Operating LP 15/07/2025                        | 119 620          | 0,07              |
| 180 000 2.750% Deere & Co 15/04/2025  | 174 490          | 0,10              |
| 135 000 5.450% Dell International LLC / EMC Corp 15/06/2023                 | 134 957          | 0,07              |
| 150 000 4.000% Dell International LLC / EMC Corp 15/07/2024                 | 147 846          | 0,08              |
| 50 000 5.850% Dell International LLC / EMC Corp 15/07/2025                  | 50 824           | 0,03              |
| 10 000 3.204% Delta Air Lines 2019-1 Class AA Pass Through Trust 25/10/2025 | 9 784            | 0,01              |
| 150 000 4.500% Deutsche Bank AG 01/04/2025                                  | 137 716          | 0,08              |
| 230 000 0.898% Deutsche Bank AG/New York NY 28/05/2024                      | 216 032          | 0,12              |
| 50 000 3.700% Deutsche Bank AG/New York NY 30/05/2024                       | 47 487           | 0,03              |
| 510 000 2.222% Deutsche Bank AG/New York NY 18/09/2024                      | 496 046          | 0,27              |
| 70 000 4.162% Deutsche Bank AG/New York NY 13/05/2025                       | 66 933           | 0,04              |
| 200 000 3.961% Deutsche Bank AG/New York NY 26/11/2025                      | 189 080          | 0,10              |
| 150 000 6.119% Deutsche Bank AG/New York NY 14/07/2026                      | 145 558          | 0,08              |
| 350 000 2.129% Deutsche Bank AG/New York NY 24/11/2026                      | 301 171          | 0,17              |
| 100 000 5.850% Devon Energy Corp 15/12/2025                                 | 101 606          | 0,06              |
| 170 000 2.200% DH Europe Finance II Sarl 15/11/2024                         | 163 214          | 0,09              |
| 50 000 3.500% Diageo Capital PLC 18/09/2023                                 | 49 560           | 0,03              |
| 100 000 2.125% Diageo Capital PLC 24/10/2024                                | 96 038           | 0,05              |
| 200 000 1.375% Diageo Capital PLC 29/09/2025                                | 184 802          | 0,10              |
| 50 000 5.200% Diageo Capital PLC 24/10/2025                                 | 50 688           | 0,03              |
| 130 000 4.200% Discover Bank 08/08/2023                                     | 129 005          | 0,07              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 150 000 2.450% Discover Bank 12/09/2024                                 | 142 144          | 0,08              |
| 190 000 3.750% Discover Financial Services 04/03/2025                   | 180 215          | 0,10              |
| 100 000 3.900% Discovery Communications LLC 15/11/2024                  | 97 375           | 0,05              |
| 70 000 3.950% Discovery Communications LLC 15/06/2025                   | 67 420           | 0,04              |
| 60 000 4.250% Dollar General Corp 20/09/2024                            | 59 334           | 0,03              |
| 100 000 4.150% Dollar General Corp 01/11/2025                           | 98 430           | 0,05              |
| 150 000 4.000% Dollar Tree Inc 15/05/2025                               | 147 118          | 0,08              |
| 145 000 3.071% Dominion Energy Inc 15/08/2024                           | 140 940          | 0,08              |
| 70 000 3.300% Dominion Energy Inc 15/03/2025                            | 67 558           | 0,04              |
| 80 000 3.900% Dominion Energy Inc 01/10/2025                            | 78 168           | 0,04              |
| 180 000 2.600% DR Horton Inc 15/10/2025                                 | 168 439          | 0,09              |
| 140 000 2.529% DTE Energy Co 01/10/2024                                 | 134 723          | 0,07              |
| 170 000 4.220% DTE Energy Co 01/11/2024                                 | 168 240          | 0,09              |
| 100 000 1.050% DTE Energy Co 01/06/2025                                 | 91 852           | 0,05              |
| 50 000 3.950% Duke Energy Corp 15/10/2023                               | 49 599           | 0,03              |
| 90 000 3.750% Duke Energy Corp 15/04/2024                               | 88 968           | 0,05              |
| 50 000 0.900% Duke Energy Corp 15/09/2025                               | 45 482           | 0,03              |
| 50 000 5.000% Duke Energy Corp 08/12/2025                               | 50 413           | 0,03              |
| 180 000 3.800% Duke Energy Ohio Inc 01/09/2023                          | 178 369          | 0,10              |
| 120 000 4.493% DuPont de Nemours Inc 15/11/2025                         | 119 905          | 0,07              |
| 140 000 2.500% Eastern Energy Gas Holdings LLC 15/11/2024               | 134 861          | 0,07              |
| 100 000 3.800% Eastman Chemical Co 15/03/2025                           | 97 526           | 0,05              |
| 20 000 3.625% Eaton Vance Corp 15/06/2023                               | 19 924           | 0,01              |
| 140 000 3.450% eBay Inc 01/08/2024                                      | 137 171          | 0,08              |
| 150 000 4.828% eBay Inc 11/03/2025                                      | 141 883          | 0,08              |
| 50 000 0.900% Ecolab Inc 15/12/2023                                     | 48 480           | 0,03              |
| 100 000 3.550% Edison International 15/11/2024                          | 97 117           | 0,05              |
| 70 000 4.950% Edison International 15/04/2025                           | 69 533           | 0,04              |
| 130 000 3.500% Elevance Health Inc 15/08/2024                           | 127 361          | 0,07              |
| 50 000 3.350% Elevance Health Inc 01/12/2024                            | 48 832           | 0,03              |
| 130 000 2.375% Elevance Health Inc 15/01/2025                           | 124 504          | 0,07              |
| 100 000 5.350% Elevance Health Inc 15/10/2025                           | 101 369          | 0,06              |
| 100 000 5.000% Eli Lilly & Co 27/02/2026                                | 100 861          | 0,06              |
| 40 000 0.833% Emera US Finance LP 15/06/2024                            | 37 772           | 0,02              |
| 130 000 5.875% Enbridge Energy Partners LP 15/10/2025                   | 132 788          | 0,07              |
| 100 000 4.000% Enbridge Inc 01/10/2023                                  | 99 135           | 0,05              |
| 100 000 3.500% Enbridge Inc 10/06/2024                                  | 97 891           | 0,05              |
| 70 000 2.500% Enbridge Inc 14/02/2025                                   | 67 042           | 0,04              |



## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 4.250% Enel Generacion Chile SA 15/04/2024                       | 49 422           | 0,03              | 100 000 4.500% Fidelity National Information Services Inc 15/07/2025    | 98 800           | 0,05              |
| 70 000 4.200% Energy Transfer LP 15/09/2023                             | 69 582           | 0,04              | 50 000 4.300% Fifth Third Bancorp 16/01/2024                            | 48 838           | 0,03              |
| 150 000 5.875% Energy Transfer LP 15/01/2024                            | 149 968          | 0,08              | 100 000 3.650% Fifth Third Bancorp 25/01/2024                           | 97 592           | 0,05              |
| 60 000 4.250% Energy Transfer LP 01/04/2024                             | 59 235           | 0,03              | 180 000 2.375% Fifth Third Bancorp 28/01/2025                           | 167 236          | 0,09              |
| 150 000 4.500% Energy Transfer LP 15/04/2024                            | 148 261          | 0,08              | 250 000 5.852% Fifth Third Bank NA 27/10/2025                           | 246 992          | 0,14              |
| 120 000 3.900% Energy Transfer LP 15/05/2024                            | 117 550          | 0,06              | 100 000 3.850% Fifth Third Bank NA 15/03/2026                           | 91 342           | 0,05              |
| 100 000 4.050% Energy Transfer LP 15/03/2025                            | 98 103           | 0,05              | 110 000 3.550% First Horizon Corp 26/05/2023                            | 108 943          | 0,06              |
| 155 000 2.900% Energy Transfer LP 15/05/2025                            | 147 741          | 0,08              | 50 000 3.929% First-Citizens Bank & Trust Co 19/06/2024                 | 48 713           | 0,03              |
| 100 000 4.750% Energy Transfer LP 15/01/2026                            | 98 844           | 0,05              | 175 000 3.800% Fiserv Inc 01/10/2023                                    | 173 378          | 0,10              |
| 50 000 0.900% Entergy Corp 15/09/2025                                   | 45 084           | 0,02              | 190 000 2.750% Fiserv Inc 01/07/2024                                    | 184 403          | 0,10              |
| 30 000 4.050% Entergy Louisiana LLC 01/09/2023                          | 29 782           | 0,02              | 100 000 3.850% Fiserv Inc 01/06/2025                                    | 97 913           | 0,05              |
| 131 000 0.620% Entergy Louisiana LLC 17/11/2023                         | 127 056          | 0,07              | 100 000 4.750% Flex Ltd 15/06/2025                                      | 98 351           | 0,05              |
| 210 000 0.950% Entergy Louisiana LLC 01/10/2024                         | 197 885          | 0,11              | 50 000 3.250% Florida Power & Light Co 01/06/2024                       | 49 176           | 0,03              |
| 100 000 3.900% Enterprise Products Operating LLC 15/02/2024             | 98 815           | 0,05              | 250 000 2.850% Florida Power & Light Co 01/04/2025                      | 242 537          | 0,13              |
| 130 000 3.750% Enterprise Products Operating LLC 15/02/2025             | 127 916          | 0,07              | 60 000 3.125% Florida Power & Light Co 01/12/2025                       | 58 283           | 0,03              |
| 150 000 5.050% Enterprise Products Operating LLC 10/01/2026             | 152 133          | 0,08              | 50 000 5.150% FNB Corp/PA 25/08/2025                                    | 46 505           | 0,03              |
| 100 000 4.150% EOG Resources Inc 15/01/2026                             | 99 222           | 0,05              | 20 000 2.875% Fomento Economico Mexicano SAB de CV 10/05/2023           | 19 943           | 0,01              |
| 165 000 7.875% EQT Corp 01/02/2025                                      | 166 010          | 0,09              | 180 000 4.000% Fortune Brands Innovations Inc 21/09/2023                | 178 747          | 0,10              |
| 100 000 2.600% Equifax Inc 01/12/2024                                   | 95 530           | 0,05              | 180 000 4.030% Fox Corp 25/01/2024                                      | 178 029          | 0,10              |
| 220 000 2.625% Equinix Inc 18/11/2024                                   | 211 926          | 0,12              | 50 000 2.850% Franklin Resources Inc 30/03/2025                         | 47 152           | 0,03              |
| 100 000 1.000% Equinix Inc 15/09/2025                                   | 90 554           | 0,05              | 50 000 4.625% FS KKR Capital Corp 15/07/2024                            | 48 282           | 0,03              |
| 150 000 3.900% Equitable Holdings Inc 20/04/2023                        | 149 934          | 0,08              | 50 000 1.650% FS KKR Capital Corp 12/10/2024                            | 46 026           | 0,03              |
| 150 000 3.875% Essex Portfolio LP 01/05/2024                            | 147 604          | 0,08              | 80 000 4.125% FS KKR Capital Corp 01/02/2025                            | 75 938           | 0,04              |
| 160 000 2.450% Evergy Inc 15/09/2024                                    | 153 571          | 0,08              | 50 000 3.400% FS KKR Capital Corp 15/01/2026                            | 45 041           | 0,02              |
| 50 000 4.200% Eversource Energy 27/06/2024                              | 49 463           | 0,03              | 100 000 5.550% GE HealthCare Technologies Inc 15/11/2024                | 100 604          | 0,06              |
| 100 000 2.900% Eversource Energy 01/10/2024                             | 96 603           | 0,05              | 200 000 5.600% GE HealthCare Technologies Inc 15/11/2025                | 202 482          | 0,11              |
| 35 000 3.150% Eversource Energy 15/01/2025                              | 33 954           | 0,02              | 110 000 3.375% General Dynamics Corp 15/05/2023                         | 109 774          | 0,06              |
| 50 000 0.800% Eversource Energy 15/08/2025                              | 45 470           | 0,03              | 140 000 3.250% General Dynamics Corp 01/04/2025                         | 136 291          | 0,08              |
| 100 000 3.950% Exelon Corp 15/06/2025                                   | 97 889           | 0,05              | 46 000 3.500% General Dynamics Corp 15/05/2025                          | 45 101           | 0,02              |
| 280 000 1.571% Exxon Mobil Corp 15/04/2023                              | 279 563          | 0,15              | 210 000 3.650% General Mills Inc 15/02/2024                             | 206 961          | 0,11              |
| 50 000 3.176% Exxon Mobil Corp 15/03/2024                               | 49 227           | 0,03              | 370 000 6.125% General Motors Co 01/10/2025                             | 376 468          | 0,21              |
| 300 000 2.709% Exxon Mobil Corp 06/03/2025                              | 291 210          | 0,16              | 100 000 3.700% General Motors Financial Co Inc 09/05/2023               | 99 786           | 0,05              |
| 410 000 2.992% Exxon Mobil Corp 19/03/2025                              | 398 991          | 0,22              | 150 000 4.250% General Motors Financial Co Inc 15/05/2023               | 149 692          | 0,08              |
| 130 000 3.043% Exxon Mobil Corp 01/03/2026                              | 126 208          | 0,07              |   |                  |                   |
| 101 000 3.950% Federal Realty Investment Trust 15/01/2024               | 99 709           | 0,05              |   |                  |                   |
| 80 000 0.600% Fidelity National Information Services Inc 01/03/2024     | 76 502           | 0,04              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 140 000 4.150% General Motors Financial Co Inc 19/06/2023               | 139 496          | 0,08              |
| 255 000 1.700% General Motors Financial Co Inc 18/08/2023               | 251 014          | 0,14              |
| 100 000 5.100% General Motors Financial Co Inc 17/01/2024               | 99 694           | 0,05              |
| 150 000 3.950% General Motors Financial Co Inc 13/04/2024               | 147 462          | 0,08              |
| 13 000 3.500% General Motors Financial Co Inc 07/11/2024                | 12 662           | 0,01              |
| 220 000 2.900% General Motors Financial Co Inc 26/02/2025               | 210 300          | 0,12              |
| 210 000 3.800% General Motors Financial Co Inc 07/04/2025               | 204 078          | 0,11              |
| 170 000 2.750% General Motors Financial Co Inc 20/06/2025               | 161 097          | 0,09              |
| 300 000 6.050% General Motors Financial Co Inc 10/10/2025               | 304 995          | 0,17              |
| 100 000 1.250% General Motors Financial Co Inc 08/01/2026               | 90 043           | 0,05              |
| 100 000 3.375% Genpact Luxembourg Sarl 01/12/2024                       | 96 425           | 0,05              |
| 100 000 1.750% Genuine Parts Co 01/02/2025                              | 94 546           | 0,05              |
| 170 000 2.100% Georgia Power Co 30/07/2023                              | 168 084          | 0,09              |
| 50 000 8.000% Georgia-Pacific LLC 15/01/2024                            | 51 058           | 0,03              |
| 110 000 2.500% Gilead Sciences Inc 01/09/2023                           | 108 732          | 0,06              |
| 25 000 0.750% Gilead Sciences Inc 29/09/2023                            | 24 454           | 0,01              |
| 200 000 3.700% Gilead Sciences Inc 01/04/2024                           | 197 648          | 0,11              |
| 160 000 3.500% Gilead Sciences Inc 01/02/2025                           | 156 930          | 0,09              |
| 200 000 3.650% Gilead Sciences Inc 01/03/2026                           | 195 858          | 0,11              |
| 120 000 3.625% GlaxoSmithKline Capital Inc 15/05/2025                   | 118 554          | 0,07              |
| 100 000 0.534% GlaxoSmithKline Capital PLC 01/10/2023                   | 97 751           | 0,05              |
| 150 000 3.000% GlaxoSmithKline Capital PLC 01/06/2024                   | 147 012          | 0,08              |
| 120 000 3.750% Global Payments Inc 01/06/2023                           | 119 598          | 0,07              |
| 50 000 4.000% Global Payments Inc 01/06/2023                            | 49 761           | 0,03              |
| 200 000 2.650% Global Payments Inc 15/02/2025                           | 190 342          | 0,10              |
| 150 000 3.350% GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 01/09/2024         | 142 947          | 0,08              |
| 150 000 2.875% Goldman Sachs BDC Inc 15/01/2026                         | 136 180          | 0,07              |
| 100 000 1.217% Goldman Sachs Group Inc 06/12/2023                       | 97 057           | 0,05              |
| 150 000 3.625% Goldman Sachs Group Inc 20/02/2024                       | 147 879          | 0,08              |
| 250 000 4.000% Goldman Sachs Group Inc 03/03/2024                       | 246 222          | 0,14              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 15 000 3.000% Goldman Sachs Group Inc 15/03/2024                        | 14 668           | 0,01              |
| 300 000 3.850% Goldman Sachs Group Inc 08/07/2024                       | 294 894          | 0,16              |
| 170 000 0.657% Goldman Sachs Group Inc 10/09/2024                       | 166 211          | 0,09              |
| 350 000 0.925% Goldman Sachs Group Inc 21/10/2024                       | 340 791          | 0,19              |
| 190 000 5.700% Goldman Sachs Group Inc 01/11/2024                       | 191 433          | 0,11              |
| 200 000 3.500% Goldman Sachs Group Inc 23/01/2025                       | 194 620          | 0,11              |
| 380 000 1.757% Goldman Sachs Group Inc 24/01/2025                       | 368 368          | 0,20              |
| 510 000 3.500% Goldman Sachs Group Inc 01/04/2025                       | 495 241          | 0,27              |
| 173 000 3.750% Goldman Sachs Group Inc 22/05/2025                       | 168 009          | 0,09              |
| 300 000 3.272% Goldman Sachs Group Inc 29/09/2025                       | 290 910          | 0,16              |
| 220 000 4.250% Goldman Sachs Group Inc 21/10/2025                       | 213 717          | 0,12              |
| 160 000 0.855% Goldman Sachs Group Inc 12/02/2026                       | 146 382          | 0,08              |
| 420 000 1.093% Goldman Sachs Group Inc 09/12/2026                       | 375 896          | 0,21              |
| 150 000 1.431% Goldman Sachs Group Inc 09/03/2027                       | 134 079          | 0,07              |
| 90 000 3.375% Golub Capital BDC Inc 15/04/2024                          | 86 488           | 0,05              |
| 200 000 3.125% GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC 24/03/2025        | 193 262          | 0,11              |
| 100 000 3.000% Hasbro Inc 19/11/2024                                    | 96 536           | 0,05              |
| 120 000 5.000% HCA Inc 15/03/2024                                       | 119 248          | 0,07              |
| 480 000 5.375% HCA Inc 01/02/2025                                       | 480 158          | 0,26              |
| 200 000 5.250% HCA Inc 15/04/2025                                       | 200 594          | 0,11              |
| 100 000 0.900% Hershey Co 01/06/2025                                    | 92 686           | 0,05              |
| 120 000 4.450% Hewlett Packard Enterprise Co 02/10/2023                 | 119 284          | 0,07              |
| 130 000 1.450% Hewlett Packard Enterprise Co 01/04/2024                 | 125 055          | 0,07              |
| 400 000 4.900% Hewlett Packard Enterprise Co 15/10/2025                 | 398 956          | 0,22              |
| 270 000 2.700% Home Depot Inc 01/04/2023                                | 270 000          | 0,15              |
| 120 000 2.700% Home Depot Inc 15/04/2025                                | 116 302          | 0,06              |
| 100 000 4.000% Home Depot Inc 15/09/2025                                | 99 454           | 0,05              |
| 50 000 2.271% Honda Motor Co Ltd 10/03/2025                             | 47 855           | 0,03              |
| 260 000 2.300% Honeywell International Inc 15/08/2024                   | 252 522          | 0,14              |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 1.350% Honeywell International Inc 01/06/2025                    | 47 138           | 0,03              |
| 25 000 0.650% Hormel Foods Corp 03/06/2024                              | 23 776           | 0,01              |
| 100 000 3.875% Host Hotels & Resorts LP 01/04/2024                      | 97 673           | 0,05              |
| 200 000 4.000% Host Hotels & Resorts LP 15/06/2025                      | 192 218          | 0,11              |
| 100 000 2.200% HP Inc 17/06/2025  | 94 316           | 0,05              |
| 100 000 3.600% HSBC Holdings PLC 25/05/2023                             | 99 658           | 0,05              |
| 200 000 4.250% HSBC Holdings PLC 14/03/2024                             | 194 824          | 0,11              |
| 150 000 3.950% HSBC Holdings PLC 18/05/2024                             | 149 454          | 0,08              |
| 200 000 1.162% HSBC Holdings PLC 22/11/2024                             | 194 052          | 0,11              |
| 293 000 3.803% HSBC Holdings PLC 11/03/2025                             | 286 654          | 0,16              |
| 200 000 0.976% HSBC Holdings PLC 24/05/2025                             | 188 302          | 0,10              |
| 200 000 4.250% HSBC Holdings PLC 18/08/2025                             | 190 602          | 0,10              |
| 250 000 2.633% HSBC Holdings PLC 07/11/2025                             | 236 365          | 0,13              |
| 150 000 4.180% HSBC Holdings PLC 09/12/2025                             | 145 614          | 0,08              |
| 250 000 4.300% HSBC Holdings PLC 08/03/2026                             | 244 252          | 0,13              |
| 240 000 2.999% HSBC Holdings PLC 10/03/2026                             | 227 570          | 0,13              |
| 170 000 1.645% HSBC Holdings PLC 18/04/2026                             | 155 332          | 0,09              |
| 400 000 2.099% HSBC Holdings PLC 04/06/2026                             | 367 552          | 0,20              |
| 300 000 4.292% HSBC Holdings PLC 12/09/2026                             | 287 070          | 0,16              |
| 250 000 7.336% HSBC Holdings PLC 03/11/2026                             | 260 135          | 0,14              |
| 100 000 3.750% HSBC USA Inc 24/05/2024                                  | 97 693           | 0,05              |
| 200 000 0.650% Humana Inc 03/08/2023                                    | 197 180          | 0,11              |
| 100 000 4.500% Humana Inc 01/04/2025                                    | 99 364           | 0,05              |
| 70 000 2.625% Huntington Bancshares Inc/OH 06/08/2024                   | 65 502           | 0,04              |
| 130 000 4.000% Huntington Bancshares Inc/OH 15/05/2025                  | 122 635          | 0,07              |
| 200 000 3.844% Huntington Ingalls Industries Inc 01/05/2025             | 195 260          | 0,11              |
| 100 000 4.008% Huntington National Bank 16/05/2025                      | 95 665           | 0,05              |
| 200 000 5.699% Huntington National Bank 18/11/2025                      | 193 556          | 0,11              |
| 50 000 1.300% Hyatt Hotels Corp 01/10/2023                              | 48 871           | 0,03              |
| 105 000 5.375% Hyatt Hotels Corp 23/04/2025                             | 104 438          | 0,06              |
| 100 000 4.850% Hyatt Hotels Corp 15/03/2026                             | 99 557           | 0,05              |
| 100 000 5.810% Iberdrola International BV 15/03/2025                    | 102 259          | 0,06              |
| 100 000 5.800% Illumina Inc 12/12/2025                                  | 101 457          | 0,06              |
| 170 000 4.100% ING Groep NV 02/10/2023                                  | 168 560          | 0,09              |
| 100 000 3.550% ING Groep NV 09/04/2024                                  | 98 112           | 0,05              |
| 100 000 3.869% ING Groep NV 28/03/2026                                  | 96 732           | 0,05              |
| 100 000 2.700% Intel Corp 17/06/2024                                    | 97 760           | 0,05              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 410 000 3.400% Intel Corp 25/03/2025                                    | 402 940          | 0,22              |
| 220 000 3.700% Intel Corp 29/07/2025                                    | 216 854          | 0,12              |
| 150 000 3.650% Intercontinental Exchange Inc 23/05/2025                 | 147 574          | 0,08              |
| 100 000 3.375% International Business Machines Corp 01/08/2023          | 99 351           | 0,05              |
| 420 000 3.625% International Business Machines Corp 12/02/2024          | 414 905          | 0,23              |
| 350 000 3.000% International Business Machines Corp 15/05/2024          | 343 549          | 0,19              |
| 250 000 4.000% International Business Machines Corp 27/07/2025          | 247 172          | 0,14              |
| 100 000 4.500% International Business Machines Corp 06/02/2026          | 99 769           | 0,05              |
| 40 000 3.200% International Flavors & Fragrances Inc 01/05/2023         | 39 877           | 0,02              |
| 50 000 0.650% Intuit Inc 15/07/2023                                     | 49 314           | 0,03              |
| 50 000 3.750% Invesco Finance PLC 15/01/2026                            | 48 032           | 0,03              |
| 100 000 3.700% IPALCO Enterprises Inc 01/09/2024                        | 97 409           | 0,05              |
| 180 000 3.500% J M Smucker Co 15/03/2025                                | 175 678          | 0,10              |
| 30 000 0.391% J Paul Getty Trust 01/01/2024                             | 28 983           | 0,02              |
| 100 000 3.875% JB Hunt Transport Services Inc 01/03/2026                | 98 165           | 0,05              |
| 60 000 3.450% John Deere Capital Corp 07/06/2023                        | 59 829           | 0,03              |
| 50 000 0.700% John Deere Capital Corp 05/07/2023                        | 49 398           | 0,03              |
| 100 000 0.900% John Deere Capital Corp 10/01/2024                       | 96 848           | 0,05              |
| 150 000 0.450% John Deere Capital Corp 17/01/2024                       | 145 303          | 0,08              |
| 150 000 0.450% John Deere Capital Corp 07/06/2024                       | 142 842          | 0,08              |
| 20 000 3.350% John Deere Capital Corp 12/06/2024                        | 19 699           | 0,01              |
| 200 000 2.050% John Deere Capital Corp 09/01/2025                       | 192 832          | 0,11              |
| 200 000 1.250% John Deere Capital Corp 10/01/2025                       | 189 502          | 0,10              |
| 80 000 2.125% John Deere Capital Corp 07/03/2025                        | 76 620           | 0,04              |
| 220 000 3.450% John Deere Capital Corp 13/03/2025                       | 216 445          | 0,12              |
| 100 000 3.400% John Deere Capital Corp 06/06/2025                       | 97 935           | 0,05              |
| 200 000 4.050% John Deere Capital Corp 08/09/2025                       | 198 862          | 0,11              |
| 140 000 2.625% Johnson & Johnson 15/01/2025                             | 136 755          | 0,08              |
| 140 000 0.550% Johnson & Johnson 01/09/2025                             | 128 610          | 0,07              |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation | Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation | Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---------------|---|------------------|-------------------|---------------|---|------------------|-------------------|
|               | <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   |               | <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   |
|               | <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   |               | <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   |
|               | <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   |               | <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 120 000       | 2.450% Johnson & Johnson 01/03/2026                                     | 115 387          | 0,06              | 35 000        | 2.650% Kellogg Co 01/12/2023  | 34 443           | 0,02              |
| 230 000       | 3.375% JPMorgan Chase & Co 01/05/2023                                   | 229 627          | 0,13              | 50 000        | 4.350% Kemper Corp 15/02/2025   | 49 011           | 0,03              |
| 220 000       | 2.700% JPMorgan Chase & Co 18/05/2023                                   | 219 285          | 0,12              | 100 000       | 5.350% Kenvue Inc 22/03/2026  | 102 686          | 0,06              |
| 170 000       | 3.559% JPMorgan Chase & Co 23/04/2024                                   | 169 804          | 0,09              | 150 000       | 0.750% Keurig Dr Pepper Inc 15/03/2024                                  | 143 658          | 0,08              |
| 250 000       | 3.625% JPMorgan Chase & Co 13/05/2024                                   | 246 810          | 0,14              | 100 000       | 0.433% KeyBank NA/Cleveland OH 14/06/2024                               | 96 442           | 0,05              |
| 200 000       | 1.514% JPMorgan Chase & Co 01/06/2024                                   | 198 726          | 0,11              | 260 000       | 4.150% KeyBank NA/Cleveland OH 08/08/2025                               | 246 353          | 0,14              |
| 270 000       | 3.797% JPMorgan Chase & Co 23/07/2024                                   | 268 569          | 0,15              | 100 000       | 3.878% KeyCorp 23/05/2025   | 96 283           | 0,05              |
| 327 000       | 3.875% JPMorgan Chase & Co 10/09/2024                                   | 321 448          | 0,18              | 50 000        | 4.550% Keysight Technologies Inc 30/10/2024                             | 49 461           | 0,03              |
| 100 000       | 0.653% JPMorgan Chase & Co 16/09/2024                                   | 97 735           | 0,05              | 50 000        | 3.450% Kilroy Realty LP 15/12/2024                                      | 44 980           | 0,02              |
| 280 000       | 4.023% JPMorgan Chase & Co 05/12/2024                                   | 277 178          | 0,15              | 100 000       | 2.400% Kimberly-Clark Corp 01/06/2023                                   | 99 602           | 0,05              |
| 300 000       | 3.125% JPMorgan Chase & Co 23/01/2025                                   | 291 681          | 0,16              | 120 000       | 2.700% Kimco Realty OP LLC 01/03/2024                                   | 116 624          | 0,06              |
| 110 000       | 0.563% JPMorgan Chase & Co 16/02/2025                                   | 105 553          | 0,06              | 30 000        | 3.500% Kinder Morgan Energy Partners LP 01/09/2023                      | 29 743           | 0,02              |
| 100 000       | 3.220% JPMorgan Chase & Co 01/03/2025                                   | 97 877           | 0,05              | 100 000       | 4.300% Kinder Morgan Energy Partners LP 01/05/2024                      | 99 041           | 0,05              |
| 190 000       | 0.824% JPMorgan Chase & Co 01/06/2025                                   | 180 025          | 0,10              | 50 000        | 4.250% Kinder Morgan Energy Partners LP 01/09/2024                      | 49 433           | 0,03              |
| 240 000       | 3.845% JPMorgan Chase & Co 14/06/2025                                   | 235 836          | 0,13              | 265 000       | 4.300% Kinder Morgan Inc 01/06/2025                                     | 261 062          | 0,14              |
| 400 000       | 0.969% JPMorgan Chase & Co 23/06/2025                                   | 378 908          | 0,21              | 200 000       | 4.650% KLA Corp 01/11/2024  | 199 460          | 0,11              |
| 220 000       | 3.900% JPMorgan Chase & Co 15/07/2025                                   | 216 588          | 0,12              | 100 000       | 3.850% Kroger Co 01/08/2023   | 99 407           | 0,05              |
| 190 000       | 0.768% JPMorgan Chase & Co 09/08/2025                                   | 178 250          | 0,10              | 80 000        | 3.950% L3Harris Technologies Inc 28/05/2024                             | 78 712           | 0,04              |
| 280 000       | 2.301% JPMorgan Chase & Co 15/10/2025                                   | 267 686          | 0,15              | 120 000       | 3.832% L3Harris Technologies Inc 27/04/2025                             | 117 061          | 0,06              |
| 370 000       | 1.561% JPMorgan Chase & Co 10/12/2025                                   | 346 753          | 0,19              | 130 000       | 3.250% Laboratory Corp of America Holdings 01/09/2024                   | 127 318          | 0,07              |
| 100 000       | 2.595% JPMorgan Chase & Co 24/02/2026                                   | 95 070           | 0,05              | 100 000       | 3.600% Laboratory Corp of America Holdings 01/02/2025                   | 97 368           | 0,05              |
| 225 000       | 2.005% JPMorgan Chase & Co 13/03/2026                                   | 211 957          | 0,12              | 100 000       | 3.750% Lam Research Corp 15/03/2026                                     | 98 345           | 0,05              |
| 370 000       | 2.083% JPMorgan Chase & Co 22/04/2026                                   | 347 474          | 0,19              | 50 000        | 3.750% Lazard Group LLC 13/02/2025                                      | 48 651           | 0,03              |
| 460 000       | 4.080% JPMorgan Chase & Co 26/04/2026                                   | 451 237          | 0,25              | 100 000       | 3.625% Leidos Inc 15/05/2025  | 97 241           | 0,05              |
| 550 000       | 1.045% JPMorgan Chase & Co 19/11/2026                                   | 491 755          | 0,27              | 70 000        | 4.875% Lennar Corp 15/12/2023   | 69 634           | 0,04              |
| 150 000       | 3.960% JPMorgan Chase & Co 29/01/2027                                   | 145 551          | 0,08              | 120 000       | 4.500% Lennar Corp 30/04/2024   | 118 548          | 0,07              |
|               |   |                  |                   | 50 000        | 3.000% Lennox International Inc 15/11/2023                              | 49 140           | 0,03              |
|               |   |                  |                   | 100 000       | 1.350% Lennox International Inc 01/08/2025                              | 91 663           | 0,05              |
|               |   |                  |                   | 50 000        | 4.000% Lincoln National Corp 01/09/2023                                 | 49 816           | 0,03              |
|               |   |                  |                   | 50 000        | 3.350% Lincoln National Corp 09/03/2025                                 | 47 327           | 0,03              |
|               |   |                  |                   | 140 000       | 4.800% Linde Inc/CT 05/12/2024  | 140 843          | 0,08              |
|               |   |                  |                   | 100 000       | 4.700% Linde Inc/CT 05/12/2025  | 100 594          | 0,06              |
|               |   |                  |                   | 200 000       | 4.050% Lloyds Banking Group PLC 16/08/2023                              | 198 304          | 0,11              |
|               |   |                  |                   | 70 000        | 3.900% Lloyds Banking Group PLC 12/03/2024                              | 68 638           | 0,04              |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 0.695% Lloyds Banking Group PLC 11/05/2024                       | 49 688           | 0,03              | 50 000 4.250% Martin Marietta Materials Inc 02/07/2024                  | 49 575           | 0,03              |
| 50 000 4.500% Lloyds Banking Group PLC 04/11/2024                       | 48 133           | 0,03              | 160 000 3.375% Mastercard Inc 01/04/2024                                | 158 338          | 0,09              |
| 200 000 4.450% Lloyds Banking Group PLC 08/05/2025                      | 195 448          | 0,11              | 40 000 2.000% Mastercard Inc 03/03/2025                                 | 38 258           | 0,02              |
| 200 000 3.870% Lloyds Banking Group PLC 09/07/2025                      | 194 422          | 0,11              | 100 000 0.900% McCormick & Co Inc/MID 15/02/2026                        | 89 714           | 0,05              |
| 200 000 4.582% Lloyds Banking Group PLC 10/12/2025                      | 189 942          | 0,10              | 320 000 3.350% McDonald's Corp 01/04/2023                               | 320 000          | 0,18              |
| 100 000 2.438% Lloyds Banking Group PLC 05/02/2026                      | 94 078           | 0,05              | 100 000 3.250% McDonald's Corp 10/06/2024                               | 98 446           | 0,05              |
| 130 000 3.511% Lloyds Banking Group PLC 18/03/2026                      | 123 738          | 0,07              | 52 000 3.375% McDonald's Corp 26/05/2025                                | 50 774           | 0,03              |
| 200 000 4.716% Lloyds Banking Group PLC 11/08/2026                      | 194 594          | 0,11              | 100 000 1.450% McDonald's Corp 01/09/2025                               | 93 258           | 0,05              |
| 180 000 4.950% Lockheed Martin Corp 15/10/2025                          | 182 902          | 0,10              | 200 000 3.796% McKesson Corp 15/03/2024                                 | 197 362          | 0,11              |
| 130 000 2.625% Loews Corp 15/05/2023                                    | 129 368          | 0,07              | 50 000 0.900% McKesson Corp 03/12/2025                                  | 45 302           | 0,02              |
| 100 000 4.000% Lowe's Cos Inc 15/04/2025                                | 98 643           | 0,05              | 150 000 4.125% Mead Johnson Nutrition Co 15/11/2025                     | 147 838          | 0,08              |
| 100 000 4.400% Lowe's Cos Inc 08/09/2025                                | 99 367           | 0,05              | 220 000 2.800% Merck & Co Inc 18/05/2023                                | 219 347          | 0,12              |
| 150 000 3.375% Lowe's Cos Inc 15/09/2025                                | 145 366          | 0,08              | 100 000 2.900% Merck & Co Inc 07/03/2024                                | 98 208           | 0,05              |
| 100 000 1.250% LYB International Finance III LLC 01/10/2025             | 90 664           | 0,05              | 220 000 2.750% Merck & Co Inc 10/02/2025                                | 215 248          | 0,12              |
| 150 000 5.750% LyondellBasell Industries NV 15/04/2024                  | 150 088          | 0,08              | 100 000 0.750% Merck & Co Inc 24/02/2026                                | 91 505           | 0,05              |
| 140 000 3.550% M&T Bank Corp 26/07/2023                                 | 137 575          | 0,08              | 250 000 3.600% MetLife Inc 10/04/2024                                   | 246 455          | 0,14              |
| 100 000 4.000% M&T Bank Corp 15/07/2024                                 | 97 447           | 0,05              | 50 000 4.333% Microchip Technology Inc 01/06/2023                       | 49 882           | 0,03              |
| 100 000 3.625% Magna International Inc 15/06/2024                       | 98 152           | 0,05              | 30 000 2.670% Microchip Technology Inc 01/09/2023                       | 29 625           | 0,02              |
| 50 000 4.150% Magna International Inc 01/10/2025                        | 48 982           | 0,03              | 200 000 0.972% Microchip Technology Inc 15/02/2024                      | 191 998          | 0,11              |
| 110 000 5.200% Main Street Capital Corp 01/05/2024                      | 107 736          | 0,06              | 200 000 4.250% Microchip Technology Inc 01/09/2025                      | 196 730          | 0,11              |
| 150 000 4.650% Manufacturers & Traders Trust Co 27/01/2026              | 141 246          | 0,08              | 185 000 2.375% Microsoft Corp 01/05/2023                                | 184 630          | 0,10              |
| 270 000 4.700% Marathon Petroleum Corp 01/05/2025                       | 269 495          | 0,15              | 50 000 2.000% Microsoft Corp 08/08/2023                                 | 49 486           | 0,03              |
| 130 000 3.600% Marriott International Inc/MD 15/04/2024                 | 127 774          | 0,07              | 240 000 3.625% Microsoft Corp 15/12/2023                                | 238 493          | 0,13              |
| 50 000 3.750% Marriott International Inc/MD 15/03/2025                  | 48 767           | 0,03              | 80 000 2.875% Microsoft Corp 06/02/2024                                 | 78 820           | 0,04              |
| 100 000 5.750% Marriott International Inc/MD 01/05/2025                 | 101 139          | 0,06              | 330 000 2.700% Microsoft Corp 12/02/2025                                | 321 766          | 0,18              |
| 100 000 3.875% Marsh & McLennan Cos Inc 15/03/2024                      | 98 599           | 0,05              | 370 000 3.125% Microsoft Corp 03/11/2025                                | 360 913          | 0,20              |
| 100 000 3.500% Marsh & McLennan Cos Inc 03/06/2024                      | 98 149           | 0,05              | 100 000 3.750% Mid-America Apartments LP 15/06/2024                     | 98 575           | 0,05              |
| 50 000 3.500% Marsh & McLennan Cos Inc 10/03/2025                       | 48 694           | 0,03              | 220 000 3.761% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 26/07/2023            | 218 739          | 0,12              |
|   |                  |                   | 200 000 3.407% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 07/03/2024            | 196 158          | 0,11              |
|   |                  |                   | 50 000 2.801% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 18/07/2024             | 48 210           | 0,03              |
|   |                  |                   | 200 000 0.848% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 15/09/2024            | 195 502          | 0,11              |
|   |                  |                   | 340 000 2.193% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 25/02/2025            | 320 324          | 0,18              |
|   |                  |                   | 250 000 1.412% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 17/07/2025            | 229 385          | 0,13              |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>           |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>     |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                                   |                  |                   |
| 45 000 4.788% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 18/07/2025             | 44 541           | 0,02              | 150 000 3.625% National Australia Bank Ltd/New York 20/06/2023              | 149 518          | 0,08              |
| 300 000 0.953% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 19/07/2025            | 282 498          | 0,16              | 200 000 5.132% National Australia Bank Ltd/New York 22/11/2024              | 201 312          | 0,11              |
| 50 000 5.063% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 12/09/2025             | 49 635           | 0,03              | 100 000 3.500% National Australia Bank Ltd/New York 09/06/2025              | 97 439           | 0,05              |
| 430 000 0.962% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 11/10/2025            | 400 455          | 0,22              | 150 000 4.966% National Australia Bank Ltd/New York 12/01/2026              | 151 303          | 0,08              |
| 130 000 3.837% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 17/04/2026            | 125 754          | 0,07              | 80 000 0.550% National Bank of Canada 15/11/2024                            | 77 631           | 0,04              |
| 300 000 1.241% Mizuho Financial Group Inc 10/07/2024                    | 296 250          | 0,16              | 100 000 5.250% National Bank of Canada 17/01/2025                           | 99 843           | 0,06              |
| 100 000 0.849% Mizuho Financial Group Inc 08/09/2024                    | 97 798           | 0,05              | 100 000 3.750% National Bank of Canada 09/06/2025                           | 97 837           | 0,05              |
| 50 000 3.922% Mizuho Financial Group Inc 11/09/2024                     | 49 565           | 0,03              | 100 000 5.500% National Fuel Gas Co 15/01/2026                              | 99 999           | 0,06              |
| 50 000 2.839% Mizuho Financial Group Inc 16/07/2025                     | 48 141           | 0,03              | 50 000 3.900% National Retail Properties Inc 15/06/2024                     | 49 043           | 0,03              |
| 50 000 2.555% Mizuho Financial Group Inc 13/09/2025                     | 47 684           | 0,03              | 130 000 0.350% National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 08/02/2024 | 124 653          | 0,07              |
| 150 000 1.500% Mondelez International Inc 04/05/2025                    | 140 340          | 0,08              | 50 000 1.000% National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 18/10/2024  | 47 017           | 0,03              |
| 50 000 3.750% Moody's Corp 24/03/2025                                   | 48 989           | 0,03              | 70 000 1.875% National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 07/02/2025  | 66 440           | 0,04              |
| 40 000 4.100% Morgan Stanley 22/05/2023                                 | 39 909           | 0,02              | 50 000 3.450% National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 15/06/2025  | 48 555           | 0,03              |
| 210 000 0.731% Morgan Stanley 05/04/2024                                | 210 000          | 0,12              | 90 000 5.450% National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 30/10/2025  | 91 473           | 0,05              |
| 160 000 3.737% Morgan Stanley 24/04/2024                                | 159 738          | 0,09              | 80 000 3.250% National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 01/11/2025  | 76 983           | 0,04              |
| 290 000 3.875% Morgan Stanley 29/04/2024                                | 286 381          | 0,16              | 50 000 6.000% NatWest Group PLC 19/12/2023                                  | 50 050           | 0,03              |
| 340 000 3.700% Morgan Stanley 23/10/2024                                | 334 023          | 0,18              | 10 000 2.359% NatWest Group PLC 22/05/2024                                  | 9 947            | 0,01              |
| 310 000 0.791% Morgan Stanley 22/01/2025                                | 298 232          | 0,16              | 150 000 4.519% NatWest Group PLC 25/06/2024                                 | 149 263          | 0,08              |
| 300 000 3.620% Morgan Stanley 17/04/2025                                | 294 456          | 0,16              | 310 000 4.269% NatWest Group PLC 22/03/2025                                 | 303 853          | 0,17              |
| 500 000 0.790% Morgan Stanley 30/05/2025                                | 473 440          | 0,26              | 200 000 7.472% NatWest Group PLC 10/11/2026                                 | 207 448          | 0,11              |
| 240 000 2.720% Morgan Stanley 22/07/2025                                | 231 523          | 0,13              | 230 000 3.754% NatWest Group PLC 01/11/2029                                 | 215 699          | 0,12              |
| 215 000 4.000% Morgan Stanley 23/07/2025                                | 210 842          | 0,12              | 200 000 1.875% NetApp Inc 22/06/2025  | 186 664          | 0,10              |
| 390 000 1.164% Morgan Stanley 21/10/2025                                | 364 272          | 0,20              | 50 000 5.900% New York Community Bancorp Inc 06/11/2028                     | 47 457           | 0,03              |
| 300 000 5.000% Morgan Stanley 24/11/2025                                | 298 527          | 0,16              | 250 000 2.940% NextEra Energy Capital Holdings Inc 21/03/2024               | 243 897          | 0,13              |
| 240 000 2.630% Morgan Stanley 18/02/2026                                | 227 938          | 0,13              | 190 000 4.255% NextEra Energy Capital Holdings Inc 01/09/2024               | 188 189          | 0,10              |
| 460 000 2.188% Morgan Stanley 28/04/2026                                | 432 253          | 0,24              | 375 000 6.051% NextEra Energy Capital Holdings Inc 01/03/2025               | 381 577          | 0,21              |
| 200 000 4.679% Morgan Stanley 17/07/2026                                | 197 324          | 0,11              | 100 000 4.450% NextEra Energy Capital Holdings Inc 20/06/2025               | 99 560           | 0,05              |
| 300 000 6.138% Morgan Stanley 16/10/2026                                | 306 912          | 0,17              | 140 000 2.400% NIKE Inc 27/03/2025  | 135 895          | 0,07              |
| 420 000 0.985% Morgan Stanley 10/12/2026                                | 374 333          | 0,21              | 105 000 0.950% NiSource Inc 15/08/2025                                      | 95 878           | 0,05              |
| 100 000 4.250% Mosaic Co 15/11/2023                                     | 99 044           | 0,05              | 260 000 2.648% Nomura Holdings Inc 16/01/2025                               | 246 319          | 0,14              |
| 100 000 4.875% MPLX LP 01/12/2024                                       | 99 397           | 0,05              |   |                  |                   |
| 50 000 4.000% MPLX LP 15/02/2025  | 48 972           | 0,03              |   |                  |                   |
| 220 000 4.875% MPLX LP 01/06/2025                                       | 218 473          | 0,12              |   |                  |                   |
| 100 000 1.750% MPLX LP 01/03/2026                                       | 91 309           | 0,05              |   |                  |                   |
| 50 000 4.200% Mylan Inc 29/11/2023                                      | 49 466           | 0,03              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 5.099% Nomura Holdings Inc 03/07/2025                           | 98 332           | 0,05              | 240 000 2.950% Oracle Corp 15/11/2024                                   | 233 191          | 0,13              |
| 100 000 1.851% Nomura Holdings Inc 16/07/2025                           | 91 621           | 0,05              | 460 000 2.500% Oracle Corp 01/04/2025                                   | 440 068          | 0,24              |
| 100 000 3.850% Norfolk Southern Corp 15/01/2024                         | 98 852           | 0,05              | 410 000 2.950% Oracle Corp 15/05/2025                                   | 394 797          | 0,22              |
| 90 000 2.600% Northern States Power Co/MN 15/05/2023                    | 89 703           | 0,05              | 340 000 1.650% Oracle Corp 25/03/2026                                   | 312 382          | 0,17              |
| 75 000 3.250% Northrop Grumman Corp 01/08/2023                          | 74 516           | 0,04              | 50 000 4.050% ORIX Corp 16/01/2024                                      | 49 443           | 0,03              |
| 240 000 2.930% Northrop Grumman Corp 15/01/2025                         | 232 654          | 0,13              | 50 000 3.250% ORIX Corp 04/12/2024                                      | 48 471           | 0,03              |
| 290 000 3.400% Novartis Capital Corp 06/05/2024                         | 286 326          | 0,16              | 100 000 2.056% Otis Worldwide Corp 05/04/2025                           | 94 467           | 0,05              |
| 220 000 1.750% Novartis Capital Corp 14/02/2025                         | 209 816          | 0,12              | 70 000 4.200% Owens Corning 01/12/2024                                  | 69 077           | 0,04              |
| 70 000 3.000% Novartis Capital Corp 20/11/2025                          | 67 985           | 0,04              | 50 000 5.250% Owl Rock Capital Corp 15/04/2024                          | 48 697           | 0,03              |
| 30 000 3.950% Nucor Corp 23/05/2025                                     | 29 545           | 0,02              | 100 000 4.000% Owl Rock Capital Corp 30/03/2025                         | 93 249           | 0,05              |
| 70 000 2.000% Nucor Corp 01/06/2025                                     | 65 816           | 0,04              | 100 000 3.750% Owl Rock Capital Corp 22/07/2025                         | 91 610           | 0,05              |
| 10 000 1.900% Nutrien Ltd 13/05/2023                                    | 9 954            | 0,01              | 70 000 3.400% PACCAR Financial Corp 09/08/2023                          | 69 457           | 0,04              |
| 130 000 5.900% Nutrien Ltd 07/11/2024                                   | 131 867          | 0,07              | 170 000 0.350% PACCAR Financial Corp 11/08/2023                         | 166 897          | 0,09              |
| 50 000 5.950% Nutrien Ltd 07/11/2025                                    | 51 438           | 0,03              | 140 000 0.350% PACCAR Financial Corp 02/02/2024                         | 134 396          | 0,07              |
| 65 000 0.309% NVIDIA Corp 15/06/2023                                    | 64 366           | 0,04              | 70 000 0.500% PACCAR Financial Corp 09/08/2024                          | 66 060           | 0,04              |
| 180 000 0.584% NVIDIA Corp 14/06/2024                                   | 171 904          | 0,09              | 39 000 3.550% PACCAR Financial Corp 11/08/2025                          | 38 237           | 0,02              |
| 100 000 4.875% NXP BV / NXP Funding LLC 01/03/2024                      | 99 266           | 0,05              | 100 000 4.250% Pacific Gas and Electric Co 01/08/2023                   | 99 399           | 0,05              |
| 70 000 2.700% NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 01/05/2025         | 66 390           | 0,04              | 235 000 1.700% Pacific Gas and Electric Co 15/11/2023                   | 229 019          | 0,13              |
| 120 000 0.703% OGE Energy Corp 26/05/2023                               | 119 146          | 0,07              | 230 000 4.950% Pacific Gas and Electric Co 08/06/2025                   | 227 196          | 0,13              |
| 50 000 4.875% Old Republic International Corp 01/10/2024                | 49 361           | 0,03              | 150 000 3.500% Pacific Gas and Electric Co 15/06/2025                   | 143 028          | 0,08              |
| 11 000 4.375% Omega Healthcare Investors Inc 01/08/2023                 | 10 887           | 0,01              | 150 000 3.150% Pacific Gas and Electric Co 01/01/2026                   | 139 899          | 0,08              |
| 50 000 4.950% Omega Healthcare Investors Inc 01/04/2024                 | 49 339           | 0,03              | 100 000 4.000% Paramount Global 15/01/2026                              | 96 858           | 0,05              |
| 100 000 4.500% Omega Healthcare Investors Inc 15/01/2025                | 96 860           | 0,05              | 270 000 2.700% Parker-Hannifin Corp 14/06/2024                          | 262 772          | 0,14              |
| 160 000 3.650% Omnicom Group Inc / Omnicom Capital Inc 01/11/2024       | 156 808          | 0,09              | 60 000 3.650% Parker-Hannifin Corp 15/06/2024                           | 59 111           | 0,03              |
| 50 000 2.750% Oncor Electric Delivery Co LLC 01/06/2024                 | 48 793           | 0,03              | 125 000 2.400% PayPal Holdings Inc 01/10/2024                           | 121 046          | 0,07              |
| 50 000 0.550% Oncor Electric Delivery Co LLC 01/10/2025                 | 45 089           | 0,02              | 100 000 1.650% PayPal Holdings Inc 01/06/2025                           | 93 850           | 0,05              |
| 30 000 3.610% ONE Gas Inc 01/02/2024                                    | 29 523           | 0,02              | 255 000 0.750% PepsiCo Inc 01/05/2023                                   | 254 153          | 0,14              |
| 90 000 1.100% ONE Gas Inc 11/03/2024                                    | 86 449           | 0,05              | 100 000 3.600% PepsiCo Inc 01/03/2024                                   | 98 886           | 0,05              |
| 100 000 2.200% ONEOK Inc 15/09/2025                                     | 92 820           | 0,05              | 320 000 2.250% PepsiCo Inc 19/03/2025                                   | 308 813          | 0,17              |
| 100 000 5.850% ONEOK Inc 15/01/2026                                     | 101 692          | 0,06              | 100 000 3.500% PepsiCo Inc 17/07/2025                                   | 98 576           | 0,05              |
| 180 000 4.900% ONEOK Partners LP 15/03/2025                             | 178 904          | 0,10              | 100 000 0.550% PerkinElmer Inc 15/09/2023                               | 97 844           | 0,05              |
| 90 000 3.625% Oracle Corp 15/07/2023                                    | 89 494           | 0,05              | 100 000 0.850% PerkinElmer Inc 15/09/2024                               | 93 733           | 0,05              |
| 150 000 2.400% Oracle Corp 15/09/2023                                   | 148 012          | 0,08              | 70 000 3.000% Pfizer Inc 15/06/2023                                     | 69 699           | 0,04              |
| 90 000 3.400% Oracle Corp 08/07/2024                                    | 88 184           | 0,05              | 90 000 2.950% Pfizer Inc 15/03/2024                                     | 88 417           | 0,05              |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>            |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>      |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                                    |                  |                   | <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 150 000 3.400% Pfizer Inc 15/05/2024   | 147 927          | 0,08              | 100 000 2.700% Procter & Gamble Co 02/02/2026                           | 96 816           | 0,05              |
| 150 000 0.800% Pfizer Inc 28/05/2025   | 139 425          | 0,08              | 170 000 5.625% Prudential Financial Inc 15/06/2043                      | 167 215          | 0,09              |
| 120 000 1.125% Philip Morris International Inc 01/05/2023                    | 119 626          | 0,07              | 50 000 5.200% Prudential Financial Inc 15/03/2044                       | 47 494           | 0,03              |
| 150 000 2.125% Philip Morris International Inc 10/05/2023                    | 149 442          | 0,08              | 140 000 5.375% Prudential Financial Inc 15/05/2045                      | 130 522          | 0,07              |
| 150 000 2.875% Philip Morris International Inc 01/05/2024                    | 146 772          | 0,08              | 150 000 3.500% Public Service Co of New Hampshire 01/11/2023            | 148 212          | 0,08              |
| 50 000 3.250% Philip Morris International Inc 10/11/2024                     | 48 858           | 0,03              | 50 000 2.375% Public Service Electric and Gas Co 15/05/2023             | 49 813           | 0,03              |
| 100 000 1.500% Philip Morris International Inc 01/05/2025                    | 93 604           | 0,05              | 60 000 3.250% Public Service Electric and Gas Co 01/09/2023             | 59 438           | 0,03              |
| 150 000 3.375% Philip Morris International Inc 11/08/2025                    | 145 392          | 0,08              | 200 000 2.875% Public Service Enterprise Group Inc 15/06/2024           | 194 492          | 0,11              |
| 150 000 4.875% Philip Morris International Inc 13/02/2026                    | 151 099          | 0,08              | 80 000 4.625% PVH Corp 10/07/2025                                       | 78 276           | 0,04              |
| 100 000 2.750% Philip Morris International Inc 25/02/2026                    | 94 768           | 0,05              | 70 000 1.750% Qorvo Inc 15/12/2024                                      | 65 281           | 0,04              |
| 150 000 0.900% Phillips 66 15/02/2024  | 144 525          | 0,08              | 100 000 2.900% QUALCOMM Inc 20/05/2024                                  | 98 188           | 0,05              |
| 75 000 3.850% Phillips 66 09/04/2025   | 73 328           | 0,04              | 195 000 3.450% QUALCOMM Inc 20/05/2025                                  | 191 313          | 0,11              |
| 120 000 3.400% Piedmont Operating Partnership LP 01/06/2023                  | 118 771          | 0,07              | 80 000 0.950% Quanta Services Inc 01/10/2024                            | 74 607           | 0,04              |
| 100 000 0.550% Pioneer Natural Resources Co 15/05/2023                       | 99 380           | 0,05              | 110 000 6.625% Radian Group Inc 15/03/2025                              | 109 388          | 0,06              |
| 50 000 3.850% Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp 15/10/2023  | 49 477           | 0,03              | 165 000 3.200% Raytheon Technologies Corp 15/03/2024                    | 162 126          | 0,09              |
| 100 000 3.600% Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp 01/11/2024 | 97 542           | 0,05              | 160 000 3.950% Raytheon Technologies Corp 16/08/2025                    | 157 960          | 0,09              |
| 220 000 4.650% Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp 15/10/2025 | 217 950          | 0,12              | 70 000 4.600% Realty Income Corp 06/02/2024                             | 69 437           | 0,04              |
| 130 000 3.500% PNC Bank NA 08/06/2023  | 129 354          | 0,07              | 75 000 3.875% Realty Income Corp 15/07/2024                             | 73 611           | 0,04              |
| 100 000 3.800% PNC Bank NA 25/07/2023  | 99 204           | 0,05              | 100 000 3.875% Realty Income Corp 15/04/2025                            | 97 528           | 0,05              |
| 50 000 2.500% PNC Bank NA 27/08/2024   | 48 016           | 0,03              | 100 000 4.625% Realty Income Corp 01/11/2025                            | 98 732           | 0,05              |
| 50 000 2.950% PNC Bank NA 23/02/2025   | 47 713           | 0,03              | 200 000 6.050% Regal Rexnord Corp 15/02/2026                            | 201 368          | 0,11              |
| 75 000 3.875% PNC Bank NA 10/04/2025   | 72 484           | 0,04              | 50 000 2.250% Regions Financial Corp 18/05/2025                         | 46 062           | 0,03              |
| 160 000 3.250% PNC Bank NA 01/06/2025  | 152 802          | 0,08              | 50 000 1.300% Reliance Steel & Aluminum Co 15/08/2025                   | 45 938           | 0,03              |
| 100 000 3.500% PNC Financial Services Group Inc 23/01/2024                   | 98 144           | 0,05              | 50 000 3.700% RenaissanceRe Finance Inc 01/04/2025                      | 48 914           | 0,03              |
| 130 000 3.900% PNC Financial Services Group Inc 29/04/2024                   | 127 390          | 0,07              | 190 000 2.500% Republic Services Inc 15/08/2024                         | 184 123          | 0,10              |
| 200 000 4.758% PNC Financial Services Group Inc 26/01/2027                   | 197 552          | 0,11              | 380 000 4.450% Reynolds American Inc 12/06/2025                         | 373 221          | 0,21              |
| 100 000 1.200% PPG Industries Inc 15/03/2026                                 | 90 184           | 0,05              | 50 000 0.350% Rockwell Automation Inc 15/08/2023                        | 49 102           | 0,03              |
| 50 000 3.250% Precision Castparts Corp 15/06/2025                            | 48 800           | 0,03              | 190 000 4.100% Rogers Communications Inc 01/10/2023                     | 188 313          | 0,10              |
| 100 000 3.400% Principal Financial Group Inc 15/05/2025                      | 96 422           | 0,05              | 100 000 2.950% Rogers Communications Inc 15/03/2025                     | 96 241           | 0,05              |
| 10 000 3.100% Procter & Gamble Co 15/08/2023                                 | 9 939            | 0,01              | 100 000 3.650% Roper Technologies Inc 15/09/2023                        | 99 053           | 0,05              |
| 150 000 0.550% Procter & Gamble Co 29/10/2025                                | 137 523          | 0,08              | 100 000 2.350% Roper Technologies Inc 15/09/2024                        | 96 241           | 0,05              |



## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD                                  | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets  |         |      |
|---|---|-------------------|---|------------------|--|---------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |   |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |  |         |      |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |   |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |  |         |      |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |   |                   | <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |  |         |      |
| 80 000  | 1.600% Royal Bank of Canada 17/04/2023            | 79 856            | 0,04  | 180 000          | 6.833% Santander UK Group Holdings PLC 21/11/2026            | 182 450 | 0,10 |
| 100 000   | 3.700% Royal Bank of Canada 05/10/2023            | 99 090            | 0,05  | 100 000          | 4.000% Santander UK PLC 13/03/2024                           | 98 278  | 0,05 |
| 160 000   | 0.500% Royal Bank of Canada 26/10/2023            | 155 747           | 0,09  | 100 000          | 1.400% Schlumberger Finance Canada Ltd 17/09/2025            | 92 504  | 0,05 |
| 170 000   | 2.550% Royal Bank of Canada 16/07/2024            | 164 521           | 0,09  | 210 000          | 3.650% Schlumberger Investment SA 01/12/2023                 | 207 629 | 0,11 |
| 200 000   | 3.970% Royal Bank of Canada 26/07/2024            | 197 306           | 0,11  | 120 000          | 3.300% Sempra Energy 01/04/2025                              | 116 237 | 0,06 |
| 220 000   | 0.650% Royal Bank of Canada 29/07/2024            | 207 799           | 0,11  | 95 000           | 0.375% Shell International Finance BV 15/09/2023             | 92 897  | 0,05 |
| 200 000   | 0.750% Royal Bank of Canada 07/10/2024            | 187 582           | 0,10  | 150 000          | 3.500% Shell International Finance BV 13/11/2023             | 148 576 | 0,08 |
| 100 000   | 2.250% Royal Bank of Canada 01/11/2024            | 95 760            | 0,05  | 120 000          | 2.000% Shell International Finance BV 07/11/2024             | 115 358 | 0,06 |
| 200 000   | 1.600% Royal Bank of Canada 21/01/2025            | 188 342           | 0,10  | 305 000          | 3.250% Shell International Finance BV 11/05/2025             | 298 137 | 0,16 |
| 25 000  | 3.375% Royal Bank of Canada 14/04/2025            | 24 239            | 0,01  | 70 000           | 3.125% Sherwin-Williams Co 01/06/2024                        | 68 441  | 0,04 |
| 200 000   | 1.150% Royal Bank of Canada 10/06/2025            | 184 056           | 0,10  | 140 000          | 4.050% Sherwin-Williams Co 08/08/2024                        | 138 412 | 0,08 |
| 200 000   | 4.875% Royal Bank of Canada 12/01/2026            | 200 384           | 0,11  | 151 000          | 2.875% Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 23/09/2023 | 149 119 | 0,08 |
| 300 000   | 4.650% Royal Bank of Canada 27/01/2026            | 295 650           | 0,16  | 80 000           | 2.750% Simon Property Group LP 01/06/2023                    | 79 537  | 0,04 |
| 90 000  | 0.750% Royalty Pharma PLC 02/09/2023              | 88 163            | 0,05  | 240 000          | 2.000% Simon Property Group LP 13/09/2024                    | 229 421 | 0,13 |
| 100 000   | 1.200% Royalty Pharma PLC 02/09/2025              | 90 706            | 0,05  | 50 000           | 3.375% Simon Property Group LP 01/10/2024                    | 48 791  | 0,03 |
| 50 000  | 3.750% Ryder System Inc 09/06/2023                | 49 799            | 0,03  | 100 000          | 3.500% Simon Property Group LP 01/09/2025                    | 96 515  | 0,05 |
| 110 000   | 3.650% Ryder System Inc 18/03/2024                | 108 104           | 0,06  | 70 000           | 3.300% Simon Property Group LP 15/01/2026                    | 67 014  | 0,04 |
| 50 000  | 2.500% Ryder System Inc 01/09/2024                | 48 126            | 0,03  | 50 000           | 0.900% Skyworks Solutions Inc 01/06/2023                     | 49 633  | 0,03 |
| 50 000  | 3.350% Ryder System Inc 01/09/2025                | 47 688            | 0,03  | 70 000           | 1.800% Sonoco Products Co 01/02/2025                         | 65 704  | 0,04 |
| 160 000   | 5.750% Sabine Pass Liquefaction LLC 15/05/2024    | 160 373           | 0,09  | 180 000          | 0.700% Southern California Edison Co 01/08/2023              | 177 316 | 0,10 |
| 270 000   | 5.625% Sabine Pass Liquefaction LLC 01/03/2025    | 271 693           | 0,15  | 49 000           | 3.500% Southern California Edison Co 01/10/2023              | 48 485  | 0,03 |
| 100 000   | 3.250% Salesforce Inc 11/04/2023                  | 99 951            | 0,06  | 70 000           | 1.100% Southern California Edison Co 01/04/2024              | 67 266  | 0,04 |
| 100 000   | 0.625% Salesforce Inc 15/07/2024                  | 95 034            | 0,05  | 130 000          | 0.975% Southern California Edison Co 01/08/2024              | 123 183 | 0,07 |
| 100 000   | 3.375% Sanofi 19/06/2023                          | 99 583            | 0,05  | 25 000           | 1.200% Southern California Edison Co 01/02/2026              | 22 492  | 0,01 |
| 230 000   | 3.450% Santander Holdings USA Inc 02/06/2025      | 216 216           | 0,12  | 90 000           | 3.150% Southern California Gas Co 15/09/2024                 | 87 918  | 0,05 |
| 90 000  | 4.260% Santander Holdings USA Inc 09/06/2025      | 86 855            | 0,05  | 80 000           | 2.950% Southern Co 01/07/2023                                | 79 526  | 0,04 |
| 100 000   | 4.500% Santander Holdings USA Inc 17/07/2025      | 95 515            | 0,05  | 100 000          | 0.600% Southern Co 26/02/2024                                | 95 817  | 0,05 |
| 100 000   | 4.796% Santander UK Group Holdings PLC 15/11/2024 | 98 736            | 0,05  | 160 000          | 4.475% Southern Co 01/08/2024                                | 157 880 | 0,09 |
| 220 000   | 1.089% Santander UK Group Holdings PLC 15/03/2025 | 208 023           | 0,11  | 30 000           | 5.150% Southern Co 06/10/2025                                | 30 362  | 0,02 |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 4.000% Southern Co 15/01/2051                                   | 92 291           | 0,05              |
| 90 000 3.875% Southern Copper Corp 23/04/2025                           | 87 410           | 0,05              |
| 220 000 5.250% Southwest Airlines Co 04/05/2025                         | 220 704          | 0,12              |
| 100 000 4.750% Spectra Energy Partners LP 15/03/2024                    | 99 316           | 0,05              |
| 70 000 3.500% Spectra Energy Partners LP 15/03/2025                     | 67 878           | 0,04              |
| 30 000 3.688% SSM Health Care Corp 01/06/2023                           | 29 907           | 0,02              |
| 100 000 3.400% Stanley Black & Decker Inc 01/03/2026                    | 95 804           | 0,05              |
| 150 000 4.000% Stanley Black & Decker Inc 15/03/2060                    | 118 437          | 0,07              |
| 195 000 3.800% Starbucks Corp 15/08/2025                                | 192 186          | 0,11              |
| 100 000 4.750% Starbucks Corp 15/02/2026                                | 100 655          | 0,06              |
| 100 000 2.400% Steel Dynamics Inc 15/06/2025                            | 94 699           | 0,05              |
| 200 000 5.250% Stellantis NV 15/04/2023                                 | 199 840          | 0,11              |
| 100 000 4.250% Stifel Financial Corp 18/07/2024                         | 98 523           | 0,05              |
| 50 000 0.600% Stryker Corp 01/12/2023                                   | 48 557           | 0,03              |
| 60 000 3.375% Stryker Corp 15/05/2024                                   | 58 859           | 0,03              |
| 90 000 1.150% Stryker Corp 15/06/2025                                   | 83 126           | 0,05              |
| 100 000 3.500% Stryker Corp 15/03/2026                                  | 97 399           | 0,05              |
| 100 000 3.748% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 19/07/2023           | 99 487           | 0,05              |
| 150 000 3.936% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 16/10/2023           | 148 702          | 0,08              |
| 70 000 0.508% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 12/01/2024            | 67 356           | 0,04              |
| 210 000 2.696% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 16/07/2024           | 202 755          | 0,11              |
| 100 000 2.448% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 27/09/2024           | 95 821           | 0,05              |
| 140 000 2.348% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 15/01/2025           | 132 887          | 0,07              |
| 310 000 1.474% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 08/07/2025           | 284 186          | 0,16              |
| 200 000 0.948% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 12/01/2026           | 177 722          | 0,10              |
| 200 000 5.464% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 13/01/2026           | 201 926          | 0,11              |
| 100 000 1.321% Sutter Health 15/08/2025                                 | 91 973           | 0,05              |
| 150 000 3.900% Svenska Handelsbanken AB 20/11/2023                      | 148 219          | 0,08              |
| 50 000 5.400% Synchrony Bank 22/08/2025                                 | 46 884           | 0,03              |
| 180 000 4.250% Synchrony Financial 15/08/2024                           | 168 178          | 0,09              |
| 80 000 4.875% Synchrony Financial 13/06/2025                            | 74 176           | 0,04              |
| 150 000 4.500% Synchrony Financial 23/07/2025                           | 136 173          | 0,07              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 110 000 5.200% Synovus Financial Corp 11/08/2025                        | 96 628           | 0,05              |
| 100 000 3.750% Sysco Corp 01/10/2025                                    | 97 730           | 0,05              |
| 50 000 4.400% Takeda Pharmaceutical Co Ltd 26/11/2023                   | 49 640           | 0,03              |
| 130 000 3.550% Take-Two Interactive Software Inc 14/04/2025             | 126 541          | 0,07              |
| 220 000 3.500% Target Corp 01/07/2024                                   | 217 131          | 0,12              |
| 120 000 2.250% Target Corp 15/04/2025                                   | 115 303          | 0,06              |
| 100 000 7.875% TCI Communications Inc 15/02/2026                        | 108 628          | 0,06              |
| 150 000 1.250% TD SYNEX Corp 09/08/2024                                 | 140 304          | 0,08              |
| 100 000 0.950% Teledyne Technologies Inc 01/04/2024                     | 95 862           | 0,05              |
| 30 000 2.625% Texas Instruments Inc 15/05/2024                          | 29 292           | 0,02              |
| 220 000 1.375% Texas Instruments Inc 12/03/2025                         | 207 691          | 0,11              |
| 100 000 4.000% Textron Inc 15/03/2026                                   | 98 325           | 0,05              |
| 50 000 0.797% Thermo Fisher Scientific Inc 18/10/2023                   | 48 844           | 0,03              |
| 400 000 1.215% Thermo Fisher Scientific Inc 18/10/2024                  | 379 920          | 0,21              |
| 100 000 2.500% TJX Cos Inc 15/05/2023                                   | 99 646           | 0,05              |
| 390 000 3.500% T-Mobile USA Inc 15/04/2025                              | 379 205          | 0,21              |
| 200 000 2.250% T-Mobile USA Inc 15/02/2026                              | 186 388          | 0,10              |
| 200 000 0.750% Toronto-Dominion Bank 12/06/2023                         | 198 258          | 0,11              |
| 220 000 3.500% Toronto-Dominion Bank 19/07/2023                         | 218 665          | 0,12              |
| 270 000 0.450% Toronto-Dominion Bank 11/09/2023                         | 264 049          | 0,15              |
| 50 000 0.550% Toronto-Dominion Bank 04/03/2024                          | 47 780           | 0,03              |
| 50 000 2.350% Toronto-Dominion Bank 08/03/2024                          | 48 612           | 0,03              |
| 50 000 3.250% Toronto-Dominion Bank 11/03/2024                          | 48 990           | 0,03              |
| 210 000 2.650% Toronto-Dominion Bank 12/06/2024                         | 204 240          | 0,11              |
| 275 000 0.700% Toronto-Dominion Bank 10/09/2024                         | 258 439          | 0,14              |
| 200 000 4.285% Toronto-Dominion Bank 13/09/2024                         | 197 698          | 0,11              |
| 50 000 1.450% Toronto-Dominion Bank 10/01/2025                          | 47 024           | 0,03              |
| 220 000 3.766% Toronto-Dominion Bank 06/06/2025                         | 214 258          | 0,12              |
| 100 000 1.150% Toronto-Dominion Bank 12/06/2025                         | 92 122           | 0,05              |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD   | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets                                       |         |      |
|---|--|-------------------|---|------------------|---|---------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |   |         |      |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |   |         |      |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |  |                   | <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |   |         |      |
| 100 000   | 0.750% Toronto-Dominion Bank 11/09/2025                    | 90 040            | 0,05  | 60 000           | 3.750% TransCanada PipeLines Ltd 16/10/2023             | 59 462  | 0,03 |
| 50 000  | 5.103% Toronto-Dominion Bank 09/01/2026                    | 50 299            | 0,03  | 200 000          | 1.000% TransCanada PipeLines Ltd 12/10/2024             | 187 670 | 0,10 |
| 150 000   | 2.750% TotalEnergies Capital Canada Ltd 15/07/2023         | 148 927           | 0,08  | 100 000          | 4.875% TransCanada PipeLines Ltd 15/01/2026             | 99 766  | 0,05 |
| 70 000  | 3.700% TotalEnergies Capital International SA 15/01/2024   | 69 261            | 0,04  | 100 000          | 7.850% Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC 01/02/2026 | 107 113 | 0,06 |
| 100 000   | 3.750% TotalEnergies Capital International SA 10/04/2024   | 99 326            | 0,05  | 70 000           | 2.750% Truist Bank 01/05/2023                           | 69 758  | 0,04 |
| 170 000   | 2.434% TotalEnergies Capital International SA 10/01/2025   | 164 509           | 0,09  | 50 000           | 3.200% Truist Bank 01/04/2024                           | 48 647  | 0,03 |
| 50 000  | 3.419% Toyota Motor Corp 20/07/2023                        | 49 733            | 0,03  | 70 000           | 3.689% Truist Bank 02/08/2024                           | 69 409  | 0,04 |
| 130 000   | 0.681% Toyota Motor Corp 25/03/2024                        | 124 567           | 0,07  | 300 000          | 2.150% Truist Bank 06/12/2024                           | 282 624 | 0,16 |
| 50 000  | 2.358% Toyota Motor Corp 02/07/2024                        | 48 596            | 0,03  | 50 000           | 1.500% Truist Bank 10/03/2025                           | 46 063  | 0,03 |
| 100 000   | 1.339% Toyota Motor Corp 25/03/2026                        | 91 374            | 0,05  | 200 000          | 3.625% Truist Bank 16/09/2025                           | 190 862 | 0,11 |
| 100 000   | 0.400% Toyota Motor Credit Corp 06/04/2023                 | 99 967            | 0,06  | 310 000          | 2.636% Truist Bank 17/09/2029                           | 290 479 | 0,16 |
| 235 000   | 0.500% Toyota Motor Credit Corp 14/08/2023                 | 231 068           | 0,13  | 110 000          | 3.750% Truist Financial Corp 06/12/2023                 | 108 430 | 0,06 |
| 50 000  | 1.350% Toyota Motor Credit Corp 25/08/2023                 | 49 244            | 0,03  | 150 000          | 4.000% Truist Financial Corp 01/05/2025                 | 144 828 | 0,08 |
| 150 000   | 3.450% Toyota Motor Credit Corp 20/09/2023                 | 149 143           | 0,08  | 90 000           | 3.700% Truist Financial Corp 05/06/2025                 | 86 191  | 0,05 |
| 50 000  | 2.250% Toyota Motor Credit Corp 18/10/2023                 | 49 258            | 0,03  | 50 000           | 1.200% Truist Financial Corp 05/08/2025                 | 44 976  | 0,02 |
| 200 000   | 0.450% Toyota Motor Credit Corp 11/01/2024                 | 192 958           | 0,11  | 150 000          | 4.260% Truist Financial Corp 28/07/2026                 | 144 522 | 0,08 |
| 100 000   | 2.500% Toyota Motor Credit Corp 22/03/2024                 | 97 600            | 0,05  | 50 000           | 3.050% Tucson Electric Power Co 15/03/2025              | 48 437  | 0,03 |
| 100 000   | 2.900% Toyota Motor Credit Corp 17/04/2024                 | 97 892            | 0,05  | 100 000          | 3.150% TWDC Enterprises 18 Corp 17/09/2025              | 96 757  | 0,05 |
| 160 000   | 0.500% Toyota Motor Credit Corp 18/06/2024                 | 152 256           | 0,08  | 100 000          | 3.000% TWDC Enterprises 18 Corp 13/02/2026              | 96 502  | 0,05 |
| 200 000   | 4.400% Toyota Motor Credit Corp 20/09/2024                 | 199 614           | 0,11  | 100 000          | 4.500% Tyco Electronics Group SA 13/02/2026             | 100 054 | 0,06 |
| 280 000   | 1.450% Toyota Motor Credit Corp 13/01/2025                 | 265 121           | 0,15  | 100 000          | 3.700% Tyco Electronics Group SA 15/02/2026             | 97 935  | 0,05 |
| 140 000   | 1.800% Toyota Motor Credit Corp 13/02/2025                 | 133 301           | 0,07  | 90 000           | 3.900% Tyson Foods Inc 28/09/2023                       | 89 290  | 0,05 |
| 240 000   | 3.000% Toyota Motor Credit Corp 01/04/2025                 | 232 502           | 0,13  | 90 000           | 4.000% Tyson Foods Inc 01/03/2026                       | 88 407  | 0,05 |
| 200 000   | 3.950% Toyota Motor Credit Corp 30/06/2025                 | 197 532           | 0,11  | 45 000           | 3.250% Unilever Capital Corp 07/03/2024                 | 44 337  | 0,02 |
| 50 000  | 5.400% Toyota Motor Credit Corp 10/11/2025                 | 51 305            | 0,03  | 220 000          | 2.600% Unilever Capital Corp 05/05/2024                 | 215 046 | 0,12 |
| 100 000   | 0.800% Toyota Motor Credit Corp 09/01/2026                 | 90 685            | 0,05  | 50 000           | 0.626% Unilever Capital Corp 12/08/2024                 | 47 224  | 0,03 |
| 50 000  | 3.550% Trane Technologies Luxembourg Finance SA 01/11/2024 | 48 875            | 0,03  | 70 000           | 3.500% Union Electric Co 15/04/2024                     | 68 726  | 0,04 |
|   |  |                   |   | 170 000          | 3.500% Union Pacific Corp 08/06/2023                    | 169 436 | 0,09 |
|   |  |                   |   | 160 000          | 3.150% Union Pacific Corp 01/03/2024                    | 157 277 | 0,09 |
|   |  |                   |   | 100 000          | 3.250% Union Pacific Corp 15/08/2025                    | 97 219  | 0,05 |
|   |  |                   |   | 50 000           | 2.500% United Parcel Service Inc 01/04/2023             | 50 000  | 0,03 |
|   |  |                   |   | 160 000          | 2.800% United Parcel Service Inc 15/11/2024             | 155 506 | 0,09 |
|   |  |                   |   | 110 000          | 3.900% United Parcel Service Inc 01/04/2025             | 108 679 | 0,06 |
|   |  |                   |   | 100 000          | 3.500% UnitedHealth Group Inc 15/06/2023                | 99 640  | 0,05 |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 3.500% UnitedHealth Group Inc 15/02/2024                         | 49 460           | 0,03              | 210 000 1.000% VMware Inc 15/08/2024                                    | 197 969          | 0,11              |
| 125 000 0.550% UnitedHealth Group Inc 15/05/2024                        | 119 222          | 0,07              | 100 000 4.500% VMware Inc 15/05/2025                                    | 98 823           | 0,05              |
| 150 000 2.375% UnitedHealth Group Inc 15/08/2024                        | 145 695          | 0,08              | 100 000 3.750% Vodafone Group PLC 16/01/2024                            | 98 744           | 0,05              |
| 190 000 5.000% UnitedHealth Group Inc 15/10/2024                        | 191 497          | 0,11              | 290 000 4.125% Vodafone Group PLC 30/05/2025                            | 286 752          | 0,16              |
| 130 000 3.750% UnitedHealth Group Inc 15/07/2025                        | 128 558          | 0,07              | 20 000 3.500% Vornado Realty LP 15/01/2025                              | 18 063           | 0,01              |
| 100 000 5.150% UnitedHealth Group Inc 15/10/2025                        | 101 953          | 0,06              | 90 000 5.650% Voya Financial Inc 15/05/2053                             | 86 669           | 0,05              |
| 75 000 3.600% UPMC 03/04/2025   | 73 143           | 0,04              | 60 000 0.950% Walgreens Boots Alliance Inc 17/11/2023                   | 58 305           | 0,03              |
| 50 000 3.700% US Bancorp 30/01/2024                                     | 49 301           | 0,03              | 170 000 3.800% Walgreens Boots Alliance Inc 18/11/2024                  | 166 889          | 0,09              |
| 130 000 3.375% US Bancorp 05/02/2024                                    | 127 672          | 0,07              | 210 000 2.550% Walmart Inc 11/04/2023                                   | 209 918          | 0,12              |
| 360 000 2.400% US Bancorp 30/07/2024                                    | 346 666          | 0,19              | 112 000 3.400% Walmart Inc 26/06/2023                                   | 111 652          | 0,06              |
| 200 000 3.600% US Bancorp 11/09/2024                                    | 193 788          | 0,11              | 300 000 3.300% Walmart Inc 22/04/2024                                   | 297 198          | 0,16              |
| 100 000 1.450% US Bancorp 12/05/2025                                    | 92 236           | 0,05              | 270 000 2.850% Walmart Inc 08/07/2024                                   | 264 271          | 0,15              |
| 200 000 5.727% US Bancorp 21/10/2026                                    | 200 918          | 0,11              | 214 000 3.900% Walmart Inc 09/09/2025                                   | 213 493          | 0,12              |
| 100 000 3.400% US Bank NA/Cincinnati OH 24/07/2023                      | 99 297           | 0,05              | 200 000 1.750% Walt Disney Co 30/08/2024                                | 192 482          | 0,11              |
| 75 000 2.050% US Bank NA/Cincinnati OH 21/01/2025                       | 70 777           | 0,04              | 100 000 3.700% Walt Disney Co 15/09/2024                                | 98 703           | 0,05              |
| 100 000 2.800% US Bank NA/Cincinnati OH 27/01/2025                      | 95 760           | 0,05              | 300 000 3.350% Walt Disney Co 24/03/2025                                | 294 726          | 0,16              |
| 50 000 3.500% Ventas Realty LP 15/04/2024                               | 48 906           | 0,03              | 50 000 3.700% Walt Disney Co 15/10/2025                                 | 49 176           | 0,03              |
| 200 000 2.650% Ventas Realty LP 15/01/2025                              | 190 480          | 0,10              | 100 000 3.428% Wamernedia Holdings Inc 15/03/2024                       | 97 748           | 0,05              |
| 50 000 5.250% VeriSign Inc 01/04/2025                                   | 49 947           | 0,03              | 80 000 3.528% Wamernedia Holdings Inc 15/03/2024                        | 78 213           | 0,04              |
| 25 000 4.000% Verisk Analytics Inc 15/06/2025                           | 24 450           | 0,01              | 200 000 3.638% Wamernedia Holdings Inc 15/03/2025                       | 193 506          | 0,11              |
| 180 000 0.750% Verizon Communications Inc 22/03/2024                    | 172 681          | 0,10              | 50 000 3.788% Wamernedia Holdings Inc 15/03/2025                        | 48 493           | 0,03              |
| 120 000 3.500% Verizon Communications Inc 01/11/2024                    | 117 823          | 0,06              | 190 000 6.412% Wamernedia Holdings Inc 15/03/2026                       | 191 009          | 0,11              |
| 150 000 3.376% Verizon Communications Inc 15/02/2025                    | 147 078          | 0,08              | 200 000 0.750% Waste Management Inc 15/11/2025                          | 181 954          | 0,10              |
| 80 000 0.850% Verizon Communications Inc 20/11/2025                     | 72 860           | 0,04              | 50 000 0.550% WEC Energy Group Inc 15/09/2023                           | 48 859           | 0,03              |
| 210 000 1.450% Verizon Communications Inc 20/03/2026                    | 193 265          | 0,11              | 60 000 0.800% WEC Energy Group Inc 15/03/2024                           | 57 525           | 0,03              |
| 110 000 2.400% VF Corp 23/04/2025                                       | 103 742          | 0,06              | 150 000 5.000% WEC Energy Group Inc 27/09/2025                          | 150 189          | 0,08              |
| 160 000 1.650% Viatis Inc 22/06/2025                                    | 146 982          | 0,08              | 100 000 3.500% Weibo Corp 05/07/2024                                    | 97 412           | 0,05              |
| 90 000 4.375% VICI Properties LP 15/05/2025                             | 87 357           | 0,05              | 130 000 4.125% Wells Fargo & Co 15/08/2023                              | 129 263          | 0,07              |
| 90 000 3.100% Virginia Electric and Power Co 15/05/2025                 | 86 733           | 0,05              | 500 000 3.750% Wells Fargo & Co 24/01/2024                              | 493 920          | 0,27              |
| 80 000 3.150% Virginia Electric and Power Co 15/01/2026                 | 77 438           | 0,04              | 280 000 1.654% Wells Fargo & Co 02/06/2024                              | 278 169          | 0,15              |
| 400 000 3.150% Visa Inc 14/12/2025                                      | 388 496          | 0,21              | 180 000 3.300% Wells Fargo & Co 09/09/2024                              | 175 709          | 0,10              |
| 50 000 0.600% VMware Inc 15/08/2023                                     | 49 053           | 0,03              | 150 000 3.000% Wells Fargo & Co 19/02/2025                              | 144 426          | 0,08              |
|   |                  |                   | 150 000 0.805% Wells Fargo & Co 19/05/2025                              | 142 501          | 0,08              |
|   |                  |                   | 350 000 3.550% Wells Fargo & Co 29/09/2025                              | 336 668          | 0,19              |
|   |                  |                   | 220 000 2.406% Wells Fargo & Co 30/10/2025                              | 209 227          | 0,12              |
|   |                  |                   | 360 000 2.164% Wells Fargo & Co 11/02/2026                              | 339 113          | 0,19              |

## SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|---|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b>       |                    |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 99,09 % (mars 2022 : 99,28 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Dollar américain – 99,09 % (suite)</b>                               |                    |                   |
| 190 000 3.908% Wells Fargo & Co 25/04/2026                              | 184 228            | 0,10              |
| 460 000 2.188% Wells Fargo & Co 30/04/2026                              | 431 623            | 0,24              |
| 280 000 4.540% Wells Fargo & Co 15/08/2026                              | 274 915            | 0,15              |
| 50 000 4.500% Welltower OP LLC 15/01/2024                               | 49 479             | 0,03              |
| 50 000 3.625% Welltower OP LLC 15/03/2024                               | 49 044             | 0,03              |
| 200 000 4.000% Welltower OP LLC 01/06/2025                              | 193 886            | 0,11              |
| 200 000 4.750% Western Digital Corp 15/02/2026                          | 192 640            | 0,11              |
| 70 000 2.850% Western Union Co 10/01/2025                               | 66 813             | 0,04              |
| 100 000 4.400% Westinghouse Air Brake Technologies Corp 15/03/2024      | 98 667             | 0,05              |
| 130 000 3.200% Westinghouse Air Brake Technologies Corp 15/06/2025      | 124 049            | 0,07              |
| 110 000 0.875% Westlake Corp 15/08/2024                                 | 103 829            | 0,06              |
| 250 000 3.650% Westpac Banking Corp 15/05/2023                          | 249 647            | 0,14              |
| 250 000 1.019% Westpac Banking Corp 18/11/2024                          | 235 405            | 0,13              |
| 140 000 2.350% Westpac Banking Corp 19/02/2025                          | 134 114            | 0,07              |
| 100 000 3.735% Westpac Banking Corp 26/08/2025                          | 97 827             | 0,05              |
| 100 000 2.894% Westpac Banking Corp 04/02/2030                          | 93 899             | 0,05              |
| 25 000 3.700% Whirlpool Corp 01/05/2025                                 | 24 442             | 0,01              |
| 200 000 4.300% Williams Cos Inc 04/03/2024                              | 197 984            | 0,11              |
| 80 000 4.550% Williams Cos Inc 24/06/2024                               | 79 420             | 0,04              |
| 140 000 3.900% Williams Cos Inc 15/01/2025                              | 137 491            | 0,08              |
| 100 000 4.000% Williams Cos Inc 15/09/2025                              | 97 817             | 0,05              |
| 100 000 3.600% Willis North America Inc 15/05/2024                      | 97 474             | 0,05              |
| 50 000 2.050% Wisconsin Electric Power Co 15/12/2024                    | 47 567             | 0,03              |
| 100 000 4.000% WP Carey Inc 01/02/2025                                  | 97 596             | 0,05              |
| 100 000 3.000% WRKCo Inc 15/09/2024                                     | 96 812             | 0,05              |
| 100 000 4.650% WRKCo Inc 15/03/2026                                     | 98 989             | 0,05              |
| 50 000 1.850% WW Grainger Inc 15/02/2025                                | 47 534             | 0,03              |
| 50 000 6.450% Wyeth LLC 01/02/2024                                      | 50 537             | 0,03              |
| 100 000 0.500% Xcel Energy Inc 15/10/2023                               | 97 261             | 0,05              |
| 50 000 2.950% Xilinx Inc 01/06/2024                                     | 48 895             | 0,03              |
| 230 000 3.550% Zimmer Biomet Holdings Inc 01/04/2025                    | 223 049            | 0,12              |
| 160 000 5.400% Zoetis Inc 14/11/2025                                    | 162 818            | 0,09              |
| <b>Total des obligations d'entreprise</b>                               | <b>180 049 411</b> | <b>99,09</b>      |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>                                     | <b>180 049 411</b> | <b>99,09</b>      |

|   | Juste valeur USD   | % du Comp.    |
|---|--------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | <b>180 049 411</b> | <b>99,09</b>  |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,44 %)</b>                               | <b>170 316</b>     | <b>0,09</b>   |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : 0,28 %)</b>                                      | <b>1 481 833</b>   | <b>0,82</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>181 701 560</b> | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

|  | % du total des actifs |
|--|-----------------------|
| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                                   |                       |
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs            | 87,38                 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé                        | 5,38                  |
| Autres valeurs mobilières du type mentionné dans le Règlement 68(1)(a), (b) et (c) | 6,32                  |
| Autres actifs  | 0,92                  |
| <b>Total des actifs</b>  | <b>100,00</b>         |

## SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD         |
|---|-------|----------------------|---------------------|
| <b>Actifs circulants</b>  |       |                      |                     |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :            |       |                      |                     |
|   | 1(e)  |                      |                     |
| Valeurs mobilières  |       | 275 310 071          | 114 590 737         |
| Instruments financiers dérivés  |       | 319 957              | 387 323             |
|   |       | <b>275 630 028</b>   | <b>114 978 060</b>  |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie   |       |                      |                     |
|   | 1(f)  | 6 167 389            | 682 732             |
| Créances :  |       |                      |                     |
| Produits divers à recevoir  |       | 802                  | 25                  |
| À recevoir sur cessions d'investissements   |       | 124 407 123          | 70 276 818          |
| À recevoir sur cessions d'actions de fonds  |       | 10 678 334           | -                   |
|   |       | <b>416 883 676</b>   | <b>185 937 635</b>  |
| <b>Passifs circulants</b>   |       |                      |                     |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :           |       |                      |                     |
|   | 1(e)  |                      |                     |
| Instruments financiers dérivés  |       | (26 737)             | (13 756)            |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :  |       |                      |                     |
| Charges à payer   |       | (18 266)             | (11 073)            |
| À payer sur achats d'investissements  |       | (156 745 494)        | (70 654 560)        |
|   |       | <b>(156 790 497)</b> | <b>(70 679 389)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> |       |                      |                     |
|   |       | <b>260 093 179</b>   | <b>115 258 246</b>  |
|   |       | <b>2023</b>          | <b>2022</b>         |
|   |       | <b>2021</b>          |                     |
| Valeur liquidative par action   |       |                      |                     |
| Catégorie couverte en MXN   | 5     | 2 408,69 MXN         | 2 198,04 MXN        |
| Catégorie non couverte en USD   | 5     | 103,68 USD           | 101,16 USD          |
|   |       | 2 087,55 MXN         | 101,21 USD          |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD      | 2022<br>USD      |
|---|-------|------------------|------------------|
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 4 176 890        | 100 424          |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat    | 9     | 1 912 897        | 1 013 714        |
| Produits divers   |       | 8 101            | -                |
| <b>Total des produits d'investissement</b>  |       | <b>6 097 888</b> | <b>1 114 138</b> |
| Charges opérationnelles   | 3     | (139 824)        | (261 808)        |
| <b>Bénéfice net pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>   |       | <b>5 958 064</b> | <b>852 330</b>   |
| <b>Charges financières</b>  |       |                  |                  |
| Charges d'intérêts  |       | (9 284)          | (5 913)          |
| <b>Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>5 948 780</b> | <b>846 417</b>   |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>USD        | 2022<br>USD          |
|---|--------------------|----------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier                 | 115 258 246        | 406 803 060          |
| <b>Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>5 948 780</b>   | <b>846 417</b>       |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                    |                      |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 303 472 469        | 46 368 400           |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (164 586 316)      | (338 759 631)        |
| Augmentation/(Diminution) des actifs nets résultant d'opérations sur actions  | 138 886 153        | (292 391 231)        |
| <b>Augmentation/(Diminution) totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>      | <b>144 834 933</b> | <b>(291 544 814)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>          | <b>260 093 179</b> | <b>115 258 246</b>   |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.



## SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|---|-------|----------------------|----------------------|
| <b>Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>5 948 780</b>     | <b>846 417</b>       |
| <b>Ajustement pour :</b>  |       |                      |                      |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  |       | (128 758 705)        | 291 332 510          |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés   |       | 80 347               | (184 604)            |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   |       | <b>(122 729 578)</b> | <b>291 994 323</b>   |
| Variation des montants à recevoir   |       | (777)                | -                    |
| Variation des montants à payer  |       | 7 193                | (24 491)             |
| <b>Entrées/(Sorties) de trésorerie sur opérations</b>   |       | <b>6 416</b>         | <b>(24 491)</b>      |
| <b>(Sorties)/Entrées de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  |       | <b>(122 723 162)</b> | <b>291 969 832</b>   |
| <b>Activités de financement</b>   |       |                      |                      |
| Produits des souscriptions  | 5     | 292 794 135          | 46 368 400           |
| Paiements sur rachats   | 5     | (164 586 316)        | (338 759 631)        |
| <b>Trésorerie nette générée/(utilisée) sur activités de financement</b>   |       | <b>128 207 819</b>   | <b>(292 391 231)</b> |
| <b>Augmentation/(Diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>                                      |       | <b>5 484 657</b>     | <b>(421 399)</b>     |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  |       | 682 732              | 1 104 131            |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   |       | <b>6 167 389</b>     | <b>682 732</b>       |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |       |                      |                      |
| Intérêts payés  |       | (9 284)              | (5 913)              |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 105,85 % (mars 2022 : 99,42 %)</b>          |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 105,85 % (mars 2022 : 99,42 %)</b>  |                    |                   |
| <b>Obligations d'État – 105,85 % (mars 2022 : 99,42 %)</b>          |                  |                   | <b>(suite)</b>  |                    |                   |
| <b>Dollar américain – 105,85 %</b>                                  |                  |                   | <b>Obligations d'État – 105,85 % (mars 2022 : 99,42 %)</b>  |                    |                   |
|   |                  |                   | <b>(suite)</b>  |                    |                   |
|   |                  |                   | <b>Dollar américain – 105,85 % (suite)</b>                  |                    |                   |
| 16 104 000 0.000% United States Treasury Bill<br>04/04/2023         | 16 101 944       | 6,19              | 6 000 000 0.010% United States Treasury Bill<br>06/06/2023  | 5 952 446          | 2,29              |
| 15 254 000 0.000% United States Treasury Bill<br>02/05/2023         | 15 198 755       | 5,84              | 17 200 000 0.000% United States Treasury Bill<br>08/06/2023 | 17 059 210         | 6,56              |
| 18 324 000 0.000% United States Treasury Bill<br>04/05/2023         | 18 251 101       | 7,02              | 6 100 000 0.010% United States Treasury Bill<br>13/06/2023  | 6 046 198          | 2,33              |
| 14 620 000 0.000% United States Treasury Bill<br>09/05/2023         | 14 554 655       | 5,60              | 23 100 000 0.010% United States Treasury Bill<br>15/06/2023 | 22 886 810         | 8,80              |
| 18 350 000 0.000% United States Treasury Bill<br>11/05/2023         | 18 260 900       | 7,02              | 6 100 000 0.010% United States Treasury Bill<br>20/06/2023  | 6 039 826          | 2,32              |
| 14 076 000 0.000% United States Treasury Bill<br>16/05/2023         | 13 999 973       | 5,38              | 17 400 000 0.010% United States Treasury Bill<br>22/06/2023 | 17 225 044         | 6,62              |
| 24 461 000 0.000% United States Treasury Bill<br>18/05/2023         | 24 318 183       | 9,35              | 6 100 000 0.010% United States Treasury Bill<br>27/06/2023  | 6 035 826          | 2,32              |
| 14 096 000 0.000% United States Treasury Bill<br>23/05/2023         | 14 007 041       | 5,39              | 17 500 000 0.010% United States Treasury Bill<br>29/06/2023 | 17 306 754         | 6,65              |
| 18 288 000 0.000% United States Treasury Bill<br>25/05/2023         | 18 165 694       | 6,98              | <b>Total des obligations d'État</b>                         | <b>275 310 071</b> | <b>105,85</b>     |
| 6 576 000 0.000% United States Treasury Bill<br>30/05/2023          | 6 527 897        | 2,51              | <b>Total des valeurs mobilières</b>                         | <b>275 310 071</b> | <b>105,85</b>     |
| 17 500 000 0.010% United States Treasury Bill<br>01/06/2023         | 17 371 814       | 6,68              |   |                    |                   |
| <b>Instruments financiers dérivés – 0,11 % (mars 2022 : 0,32 %)</b> |                  |                   |   |                    |                   |
| <b>Contrats de change à terme – 0,11 % (mars 2022 : 0,32 %)^</b>    |                  |                   |   |                    |                   |

| Devise achetée  | Devise vendue | Montant acheté | Montant vendu | Date d'échéance | Contrepartie                | Plus-values/<br>(Moins-values)<br>latentes<br>USD | % du<br>Comp. |
|---|---------------|----------------|---------------|-----------------|-----------------------------|---|---------------|
| MXN   | USD           | 6 988 614      | 379 000       | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | 7 973   | 0,00          |
| MXN   | USD           | 55 781 173     | 3 018 125     | 05/04/2023      | Citibank                    | 70 582  | 0,02          |
| MXN   | USD           | 55 787 137     | 3 018 125     | 05/04/2023      | Royal Bank of Canada        | 70 913  | 0,03          |
| MXN   | USD           | 55 791 378     | 3 018 125     | 05/04/2023      | JP Morgan Chase Bank        | 71 147  | 0,03          |
| MXN   | USD           | 55 793 729     | 3 018 125     | 05/04/2023      | Goldman Sachs               | 71 278  | 0,03          |
| MXN   | USD           | 56 651 561     | 3 112 875     | 04/05/2023      | Citibank                    | 6 447   | 0,00          |
| MXN   | USD           | 56 658 475     | 3 112 875     | 04/05/2023      | Westpac Banking Corporation | 6 827   | 0,00          |
| MXN   | USD           | 56 659 947     | 3 112 875     | 04/05/2023      | Merrill Lynch International | 6 908   | 0,00          |
| MXN   | USD           | 56 677 631     | 3 112 875     | 04/05/2023      | HSBC Bank                   | 7 882   | 0,00          |
| USD   | MXN           | 3 112 875      | 56 349 780    | 05/04/2023      | HSBC Bank                   | (7 317)   | (0,00)        |
| USD   | MXN           | 3 112 875      | 56 345 310    | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (7 070)   | (0,00)        |
| USD   | MXN           | 3 112 875      | 56 333 761    | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | (6 430)   | (0,00)        |
| USD   | MXN           | 3 112 875      | 56 324 541    | 05/04/2023      | Citibank                    | (5 920)   | (0,00)        |
| <b>Plus-values latentes sur contrats de change à terme</b>        |               |                |               |                 |                             | <b>319 957</b>                                    | <b>0,11</b>   |
| <b>Moins-values latentes sur contrats de change à terme</b>       |               |                |               |                 |                             | <b>(26 737)</b>                                   | <b>(0,00)</b> |
| <b>Plus-values latentes nettes sur contrats de change à terme</b> |               |                |               |                 |                             | <b>293 220</b>                                    | <b>0,11</b>   |
| <b>Total des instruments financiers dérivés</b>                   |               |                |               |                 |                             | <b>293 220</b>                                    | <b>0,11</b>   |

## SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

|   | Juste valeur<br>USD       | % du<br>Comp.        |
|---|---------------------------|----------------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | 275 603 291               | 105,96               |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,59 %)</b>                               | 6 167 389                 | 2,37                 |
| <b>Autres passifs nets (mars 2022 : (0,33 %))</b>                                   | <u>(21 677 501)</u>       | <u>(8,33)</u>        |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b><u>260 093 179</u></b> | <b><u>100,00</u></b> |

^ Les contrats à terme sont utilisés à des fins de couverture.

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

|  | % du<br>total<br>des<br>actifs |
|--|--------------------------------|
| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                                   |                                |
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs            | 23,72                          |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé                        | 5,83                           |
| Autres valeurs mobilières du type mentionné dans le Règlement 68(1)(a), (b) et (c) | 36,49                          |
| Instruments financiers dérivés négociés de gré à gré                               | 0,08                           |
| Autres actifs  | <u>33,88</u>                   |
| <b>Total des actifs</b>  | <b><u>100,00</u></b>           |

## SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>EUR         | 2022<br>EUR         |
|---|-------|---------------------|---------------------|
| <b>Actifs circulants</b>  |       |                     |                     |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :            |       |                     |                     |
|   | 1(e)  |                     |                     |
| Valeurs mobilières  |       | 620 270 852         | 703 920 934         |
|   |       | <b>620 270 852</b>  | <b>703 920 934</b>  |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie   |       |                     |                     |
|   | 1(f)  |                     |                     |
| Créances :  |       |                     |                     |
| Intérêts à recevoir   |       | 3 685 655           | 5 019 334           |
| À recevoir sur cessions d'investissements   |       | 37 227 318          | 47 946 032          |
|   |       | <b>663 902 243</b>  | <b>758 874 630</b>  |
| <b>Total des actifs circulants</b>  |       |                     |                     |
| <b>Passifs circulants</b>   |       |                     |                     |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :  |       |                     |                     |
|   |       |                     |                     |
| Charges à payer   |       | (76 775)            | (90 217)            |
| À payer sur achats d'investissements  |       | (37 013 517)        | (48 142 604)        |
|   |       | <b>(37 090 292)</b> | <b>(48 232 821)</b> |
| <b>Total des passifs circulants</b>   |       |                     |                     |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> |       |                     |                     |
|   |       | <b>626 811 951</b>  | <b>710 641 809</b>  |
|   |       |                     |                     |
|   |       | <b>2023</b>         | <b>2022</b>         |
|   |       |                     | <b>2021</b>         |
| Valeur liquidative par action   | 5     | 49,69 EUR           | 51,36 EUR           |
|   |       |                     | 52,21 EUR           |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>EUR         | 2022<br>EUR         |
|---|-------|---------------------|---------------------|
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 1 301 016           | 149 932             |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 9     | (23 820 876)        | (7 450 532)         |
| Produits divers   |       | 12 166              | -                   |
| <b>Total des charges d'investissement</b>   |       | <b>(22 507 694)</b> | <b>(7 300 600)</b>  |
| Charges opérationnelles   | 3     | (983 714)           | (1 234 234)         |
| Rendement négatif   |       | -                   | (4 162 679)         |
| <b>Perte nette pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(23 491 408)</b> | <b>(12 697 513)</b> |
| <b>Charges financières</b>  |       |                     |                     |
| Charges d'intérêts  |       | (7 196)             | (11 746)            |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(23 498 604)</b> | <b>(12 709 259)</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>EUR         | 2022<br>EUR          |
|---|---------------------|----------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier               | 710 641 809         | 1 192 545 296        |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(23 498 604)</b> | <b>(12 709 259)</b>  |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                     |                      |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 253 512 531         | 199 517 983          |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (313 843 785)       | (668 712 211)        |
| Diminution des actifs nets résultant d'opérations sur actions   | (60 331 254)        | (469 194 228)        |
| <b>Diminution totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                   | <b>(83 829 858)</b> | <b>(481 903 487)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>        | <b>626 811 951</b>  | <b>710 641 809</b>   |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>EUR         | 2022<br>EUR          |
|---|-------|---------------------|----------------------|
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(23 498 604)</b> | <b>(12 709 259)</b>  |
| <b>Ajustement pour :</b>  |       |                     |                      |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  |       | 83 239 709          | 477 121 788          |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   |       | <b>59 741 105</b>   | <b>464 412 529</b>   |
| Variation des montants à recevoir   |       | 1 333 679           | 4 342 236            |
| Variation des montants à payer  |       | (13 442)            | (60 172)             |
| <b>Entrées de trésorerie sur opérations</b>   |       | <b>1 320 237</b>    | <b>4 282 064</b>     |
| <b>Entrées de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  |       | <b>61 061 342</b>   | <b>468 694 593</b>   |
| <b>Activités de financement</b>   |       |                     |                      |
| Produits des souscriptions  | 5     | 253 512 531         | 199 517 983          |
| Paiements sur rachats   | 5     | (313 843 785)       | (668 712 211)        |
| <b>Trésorerie nette utilisée sur activités de financement</b>   |       | <b>(60 331 254)</b> | <b>(469 194 228)</b> |
| <b>Augmentation/(Diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>                                    |       | <b>730 088</b>      | <b>(499 635)</b>     |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  |       | 1 988 330           | 2 487 965            |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   |       | <b>2 718 418</b>    | <b>1 988 330</b>     |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |       |                     |                      |
| Intérêts reçus  |       | 11 541 943          | 18 917 940           |
| Intérêts payés  |       | (7 196)             | (11 746)             |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement                                     | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,96 % (mars 2022 : 99,05 %)</b>             |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,96 % (mars 2022 : 99,05 %)</b>        |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 98,96 % (mars 2022 : 99,05 %)</b>             |                  |                   | <b>Obligations d'État – 98,96 % (mars 2022 : 99,05 %)</b>        |                  |                   |
| <b>Euro – 98,96 %</b>   |                  |                   | <b>Euro – 98,96 % (suite)</b>                                    |                  |                   |
| 10 309 000 0.000% Bundesobligation 05/04/2024                         | 10 022 101       | 1,60              | 19 665 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/02/2026 | 18 214 476       | 2,91              |
| 10 144 000 0.000% Bundesobligation 18/10/2024                         | 9 732 661        | 1,55              | 5 039 000 5.400% Ireland Government Bond 13/03/2025              | 5 303 172        | 0,85              |
| 10 256 000 0.000% Bundesobligation 11/04/2025                         | 9 725 867        | 1,55              | 8 960 000 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/04/2024    | 8 673 101        | 1,38              |
| 15 646 000 0.000% Bundesobligation 10/10/2025                         | 14 693 823       | 2,35              | 6 791 000 1.850% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/05/2024    | 6 692 802        | 1,07              |
| 10 221 000 1.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/05/2024 | 10 078 110       | 1,61              | 6 890 000 1.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 30/05/2024    | 6 772 526        | 1,08              |
| 10 251 000 1.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2024 | 10 011 947       | 1,60              | 7 147 000 1.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/07/2024    | 7 021 785        | 1,12              |
| 12 623 000 0.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2025 | 12 130 829       | 1,94              | 6 414 000 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/08/2024    | 6 146 151        | 0,98              |
| 12 443 000 1.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2025 | 11 991 568       | 1,91              | 8 566 000 3.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2024    | 8 627 247        | 1,38              |
| 15 590 000 0.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2026 | 14 736 885       | 2,35              | 7 875 000 1.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/11/2024    | 7 665 919        | 1,22              |
| 7 090 000 0.200% Bundesschatzanweisungen 14/06/2024                   | 6 874 464        | 1,10              | 9 884 000 2.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2024    | 9 779 131        | 1,56              |
| 7 165 000 0.400% Bundesschatzanweisungen 13/09/2024                   | 6 928 698        | 1,11              | 5 992 000 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/12/2024    | 5 679 337        | 0,91              |
| 6 210 000 2.200% Bundesschatzanweisungen 12/12/2024                   | 6 154 418        | 0,98              | 8 328 000 0.350% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/02/2025    | 7 908 768        | 1,26              |
| 6 682 500 2.500% Bundesschatzanweisungen 13/03/2025                   | 6 656 639        | 1,06              | 11 316 000 5.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2025   | 11 679 923       | 1,86              |
| 130 000 2.750% Cyprus Government International Bond 27/06/2024        | 129 861          | 0,02              | 4 060 000 3.400% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 28/03/2025    | 4 064 060        | 0,65              |
| 900 000 0.625% Cyprus Government International Bond 03/12/2024        | 864 720          | 0,14              | 6 510 000 1.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/05/2025    | 6 275 966        | 1,00              |
| 820 000 0.000% Cyprus Government International Bond 09/02/2026        | 749 008          | 0,12              | 10 292 000 1.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/06/2025   | 9 914 900        | 1,58              |
| 1 749 000 2.000% Finland Government Bond 15/04/2024                   | 1 732 140        | 0,28              | 7 096 000 1.850% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/07/2025    | 6 882 623        | 1,10              |
| 1 951 000 0.000% Finland Government Bond 15/09/2024                   | 1 872 121        | 0,30              | 6 915 000 1.200% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/08/2025    | 6 587 022        | 1,05              |
| 2 090 000 4.000% Finland Government Bond 04/07/2025                   | 2 146 326        | 0,34              | 7 991 000 2.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/11/2025    | 7 832 139        | 1,25              |
| 3 139 000 0.875% Finland Government Bond 15/09/2025                   | 3 003 333        | 0,48              | 9 867 000 2.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2025    | 9 535 302        | 1,52              |
| 16 697 500 2.250% French Republic Government Bond OAT 25/05/2024      | 16 555 905       | 2,64              | 7 326 000 3.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/01/2026    | 7 348 637        | 1,17              |
| 16 952 000 1.750% French Republic Government Bond OAT 25/11/2024      | 16 654 492       | 2,66              | 7 400 000 0.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/02/2026    | 6 834 270        | 1,09              |
| 13 756 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/02/2025      | 13 050 042       | 2,08              | 11 140 000 4.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2026   | 11 489 016       | 1,83              |
| 21 452 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/03/2025      | 20 313 542       | 3,24              | 6 153 500 2.600% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2024   | 6 133 132        | 0,98              |
| 19 038 000 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2025      | 18 150 068       | 2,90              | 5 800 500 0.500% Kingdom of Belgium Government Bond 22/10/2024   | 5 602 645        | 0,89              |
| 14 023 000 6.000% French Republic Government Bond OAT 25/10/2025      | 15 138 810       | 2,41              |  |                  |                   |
| 15 866 000 1.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2025      | 15 188 680       | 2,42              |  |                  |                   |



## SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,96 % (mars 2022 : 99,05 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 98,96 % (mars 2022 : 99,05 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 98,96 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 9 702 000 0.800% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2025    | 9 309 845        | 1,49              |
| 5 380 000 4.500% Kingdom of Belgium Government Bond 28/03/2026    | 5 659 007        | 0,90              |
| 300 000 2.875% Latvia Government International Bond 30/04/2024    | 297 828          | 0,05              |
| 880 000 1.375% Latvia Government International Bond 23/09/2025    | 835 251          | 0,13              |
| 400 000 0.250% Lithuania Government International Bond 06/05/2025 | 371 272          | 0,06              |
| 160 000 1.250% Lithuania Government International Bond 22/10/2025 | 150 326          | 0,02              |
| 410 000 0.000% Luxembourg Government Bond 28/04/2025              | 384 473          | 0,06              |
| 7 178 000 2.000% Netherlands Government Bond 15/07/2024           | 7 109 665        | 1,13              |
| 9 193 000 0.250% Netherlands Government Bond 15/07/2025           | 8 711 471        | 1,39              |
| 5 160 000 0.000% Netherlands Government Bond 15/01/2026           | 4 800 956        | 0,77              |
| 6 229 000 2.875% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 15/10/2025     | 6 256 442        | 1,00              |
| 6 131 000 0.000% Republic of Austria Government Bond 15/07/2024   | 5 920 160        | 0,94              |
| 5 271 000 1.650% Republic of Austria Government Bond 21/10/2024   | 5 177 861        | 0,83              |
| 2 947 000 0.000% Republic of Austria Government Bond 20/04/2025   | 2 786 864        | 0,44              |
| 5 814 000 1.200% Republic of Austria Government Bond 20/10/2025   | 5 600 742        | 0,89              |
| 3 920 000 4.850% Republic of Austria Government Bond 15/03/2026   | 4 158 179        | 0,66              |
| 977 000 0.000% Slovakia Government Bond 17/06/2024                | 942 375          | 0,15              |
| 1 300 000 3.375% Slovakia Government Bond 15/11/2024              | 1 303 861        | 0,21              |
| 1 220 000 0.250% Slovakia Government Bond 14/05/2025              | 1 147 447        | 0,18              |
| 1 100 000 4.350% Slovakia Government Bond 14/10/2025              | 1 131 600        | 0,18              |
| 942 000 4.625% Slovenia Government Bond 09/09/2024                | 976 261          | 0,16              |
| 540 000 2.125% Slovenia Government Bond 28/07/2025                | 537 046          | 0,09              |
| 1 180 000 0.000% Slovenia Government Bond 13/02/2026              | 1 094 529        | 0,17              |
| 9 667 000 3.800% Spain Government Bond 30/04/2024                 | 9 754 847        | 1,56              |
| 8 650 000 0.000% Spain Government Bond 31/05/2024                 | 8 365 242        | 1,33              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR   | % des actifs nets |
|---|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,96 % (mars 2022 : 99,05 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Obligations d'État – 98,96 % (mars 2022 : 99,05 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Euro – 98,96 % (suite)</b>                                     |                    |                   |
| 7 322 000 0.250% Spain Government Bond 30/07/2024                 | 7 072 906          | 1,13              |
| 10 428 000 2.750% Spain Government Bond 31/10/2024                | 10 403 286         | 1,66              |
| 9 677 000 0.000% Spain Government Bond 31/01/2025                 | 9 193 924          | 1,47              |
| 10 080 000 1.600% Spain Government Bond 30/04/2025                | 9 829 714          | 1,57              |
| 8 120 000 0.000% Spain Government Bond 31/05/2025                 | 7 631 582          | 1,22              |
| 9 938 000 4.650% Spain Government Bond 30/07/2025                 | 10 338 303         | 1,65              |
| 11 068 000 2.150% Spain Government Bond 31/10/2025                | 10 898 549         | 1,74              |
| 8 850 000 0.000% Spain Government Bond 31/01/2026                 | 8 167 930          | 1,30              |
| <b>Total des obligations d'État</b>                               | <b>620 270 852</b> | <b>98,96</b>      |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>                               | <b>620 270 852</b> | <b>98,96</b>      |

|   | Juste valeur EUR   | % du Comp.    |
|---|--------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | 620 270 852        | 98,96         |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,28 %)</b>                               | 2 718 418          | 0,43          |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : 0,67 %)</b>                                      | 3 822 681          | 0,61          |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>626 811 951</b> | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

|  | % du total des actifs |
|--|-----------------------|
| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                                   |                       |
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs            | 86,99                 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé                        | 4,72                  |
| Autres valeurs mobilières du type mentionné dans le Règlement 68(1)(a), (b) et (c) | 1,72                  |
| Autres actifs  | 6,57                  |
| <b>Total des actifs</b>  | <b>100,00</b>         |

## SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD        | 2022<br>USD        |
|---|-------|--------------------|--------------------|
| <b>Actifs circulants</b>  |       |                    |                    |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :            |       |                    |                    |
|   | 1(e)  |                    |                    |
| Valeurs mobilières  |       | 94 418 076         | 138 681 839        |
|   |       | <b>94 418 076</b>  | <b>138 681 839</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie   |       |                    |                    |
|   | 1(f)  | 171 855            | 279 544            |
| Créances :  |       |                    |                    |
| Intérêts à recevoir   |       | 470 775            | 400 295            |
| À recevoir sur cessions d'investissements   |       | 4 519 314          | 5 949 810          |
|   |       | <b>99 580 020</b>  | <b>145 311 488</b> |
| <b>Total des actifs circulants</b>  |       |                    |                    |
| <b>Passifs circulants</b>   |       |                    |                    |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :  |       |                    |                    |
| Charges à payer   |       | (13 354)           | (20 374)           |
| À payer sur achats d'investissements  |       | (4 566 902)        | (5 964 973)        |
|   |       | <b>(4 580 256)</b> | <b>(5 985 347)</b> |
| <b>Total des passifs circulants</b>   |       |                    |                    |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> |       |                    |                    |
|   |       | <b>94 999 764</b>  | <b>139 326 141</b> |
|   |       | <b>2023</b>        | <b>2022</b>        |
|   |       | <b>2021</b>        |                    |
| Valeur liquidative par action   | 5     | 48,24 USD          | 49,05 USD          |
|   |       |                    | 50,82 USD          |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD        | 2022<br>USD        |
|---|-------|--------------------|--------------------|
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 2 770 039          | 648 931            |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 9     | (2 576 428)        | (5 294 808)        |
| Produits divers   |       | 4 000              | -                  |
| <b>Total des produits/(charges) d'investissement</b>  |       | <b>197 611</b>     | <b>(4 645 877)</b> |
| Charges opérationnelles   | 3     | (174 933)          | (218 639)          |
| <b>Bénéfice/(Perte) net(te) pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>                               |       | <b>22 678</b>      | <b>(4 864 516)</b> |
| <b>Charges financières</b>  |       |                    |                    |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables   | 7     | (1 960 511)        | (415 027)          |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(1 937 833)</b> | <b>(5 279 543)</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>USD                | 2022<br>USD               |
|---|----------------------------|---------------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier               | 139 326 141                | 140 528 405               |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(1 937 833)</b>         | <b>(5 279 543)</b>        |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                            |                           |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 222 689 938                | 128 853 871               |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | <u>(265 078 482)</u>       | <u>(124 776 592)</u>      |
| (Diminution)/Augmentation des actifs nets résultant d'opérations sur actions  | <u>(42 388 544)</u>        | <u>4 077 279</u>          |
| <b>Diminution totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                   | <b><u>(44 326 377)</u></b> | <b><u>(1 202 264)</u></b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>        | <b><u>94 999 764</u></b>   | <b><u>139 326 141</u></b> |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD         | 2022<br>USD        |
|---|-------|---------------------|--------------------|
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(1 937 833)</b>  | <b>(5 279 543)</b> |
| <b>Ajustement pour :</b>  |       |                     |                    |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  |       | 44 296 188          | 1 052 800          |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   |       | <b>42 358 355</b>   | <b>(4 226 743)</b> |
| Variation des montants à recevoir   |       | (70 480)            | 22 615             |
| Variation des montants à payer  |       | (7 020)             | 2 816              |
| <b>(Sorties)/Entrées de trésorerie sur opérations</b>   |       | <b>(77 500)</b>     | <b>25 431</b>      |
| <b>Entrées/(Sorties) de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  |       | <b>42 280 855</b>   | <b>(4 201 312)</b> |
| <b>Activités de financement</b>   |       |                     |                    |
| Produits des souscriptions  | 5     | 222 689 938         | 128 853 871        |
| Paiements sur rachats   | 5     | (265 078 482)       | (124 776 592)      |
| <b>Trésorerie nette (utilisée)/générée sur activités de financement</b>   |       | <b>(42 388 544)</b> | <b>4 077 279</b>   |
| <b>Diminution nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>   |       | <b>(107 689)</b>    | <b>(124 033)</b>   |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  |       | 279 544             | 403 577            |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   |       | <b>171 855</b>      | <b>279 544</b>     |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |       |                     |                    |
| Intérêts reçus  |       | 1 847 728           | 1 853 088          |
| Distributions payées  |       | (1 960 511)         | (415 027)          |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                                 | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                 | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,39 % (mars 2022 : 99,54 %)</b>    |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,39 % (mars 2022 : 99,54 %)</b>    |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 99,39 % (mars 2022 : 99,54 %)</b>    |                  |                   | <b>Obligations d'État – 99,39 % (mars 2022 : 99,54 %)</b>    |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,39 %</b>                            |                  |                   | <b>Dollar américain – 99,39 % (suite)</b>                    |                  |                   |
| 760 000 2.000% United States Treasury Note/Bond 30/04/2024   | 739 011          | 0,78              | 606 000 2.250% United States Treasury Note/Bond 31/10/2024   | 587 228          | 0,62              |
| 1 256 000 2.250% United States Treasury Note/Bond 30/04/2024 | 1 224 600        | 1,29              | 1 140 000 4.375% United States Treasury Note/Bond 31/10/2024 | 1 141 291        | 1,20              |
| 1 140 000 2.500% United States Treasury Note/Bond 30/04/2024 | 1 114 617        | 1,17              | 1 412 000 0.750% United States Treasury Note/Bond 15/11/2024 | 1 334 616        | 1,40              |
| 1 362 000 0.250% United States Treasury Note/Bond 15/05/2024 | 1 298 635        | 1,37              | 1 576 000 2.250% United States Treasury Note/Bond 15/11/2024 | 1 526 319        | 1,61              |
| 1 824 000 2.500% United States Treasury Note/Bond 15/05/2024 | 1 783 388        | 1,88              | 100 000 7.500% United States Treasury Note/Bond 15/11/2024   | 104 988          | 0,11              |
| 1 202 000 2.000% United States Treasury Note/Bond 31/05/2024 | 1 168 006        | 1,23              | 878 000 1.500% United States Treasury Note/Bond 30/11/2024   | 839 725          | 0,88              |
| 1 341 000 2.500% United States Treasury Note/Bond 31/05/2024 | 1 310 566        | 1,38              | 680 000 2.125% United States Treasury Note/Bond 30/11/2024   | 656 970          | 0,69              |
| 1 436 000 0.250% United States Treasury Note/Bond 15/06/2024 | 1 365 294        | 1,44              | 1 100 000 4.500% United States Treasury Note/Bond 30/11/2024 | 1 104 254        | 1,16              |
| 931 000 1.750% United States Treasury Note/Bond 30/06/2024   | 900 670          | 0,95              | 1 491 000 1.000% United States Treasury Note/Bond 15/12/2024 | 1 412 781        | 1,49              |
| 680 000 2.000% United States Treasury Note/Bond 30/06/2024   | 659 653          | 0,69              | 832 000 1.750% United States Treasury Note/Bond 31/12/2024   | 798 103          | 0,84              |
| 1 265 000 3.000% United States Treasury Note/Bond 30/06/2024 | 1 242 121        | 1,31              | 696 000 3.000% United States Treasury Note/Bond 31/12/2024   | 673 163          | 0,71              |
| 1 220 000 0.375% United States Treasury Note/Bond 15/07/2024 | 1 158 476        | 1,22              | 1 140 000 4.250% United States Treasury Note/Bond 31/12/2024 | 1 140 935        | 1,20              |
| 752 000 1.750% United States Treasury Note/Bond 31/07/2024   | 726 091          | 0,76              | 1 448 000 1.125% United States Treasury Note/Bond 15/01/2025 | 1 372 206        | 1,44              |
| 570 000 2.125% United States Treasury Note/Bond 31/07/2024   | 553 100          | 0,58              | 850 000 1.375% United States Treasury Note/Bond 31/01/2025   | 808 895          | 0,85              |
| 1 315 000 3.000% United States Treasury Note/Bond 31/07/2024 | 1 290 806        | 1,36              | 678 000 2.500% United States Treasury Note/Bond 31/01/2025   | 658 269          | 0,69              |
| 1 536 000 0.375% United States Treasury Note/Bond 15/08/2024 | 1 454 492        | 1,53              | 1 144 000 4.125% United States Treasury Note/Bond 31/01/2025 | 1 143 732        | 1,20              |
| 1 625 000 2.375% United States Treasury Note/Bond 15/08/2024 | 1 581 709        | 1,67              | 1 337 000 1.500% United States Treasury Note/Bond 15/02/2025 | 1 273 545        | 1,34              |
| 817 000 1.250% United States Treasury Note/Bond 31/08/2024   | 782 214          | 0,82              | 1 410 000 2.000% United States Treasury Note/Bond 15/02/2025 | 1 355 473        | 1,43              |
| 710 000 1.875% United States Treasury Note/Bond 31/08/2024   | 685 816          | 0,72              | 100 000 7.625% United States Treasury Note/Bond 15/02/2025   | 106 156          | 0,11              |
| 1 199 000 3.250% United States Treasury Note/Bond 31/08/2024 | 1 180 640        | 1,24              | 852 000 1.125% United States Treasury Note/Bond 28/02/2025   | 805 539          | 0,85              |
| 1 516 000 0.375% United States Treasury Note/Bond 15/09/2024 | 1 432 205        | 1,51              | 771 000 2.750% United States Treasury Note/Bond 28/02/2025   | 751 815          | 0,79              |
| 865 000 1.500% United States Treasury Note/Bond 30/09/2024   | 829 724          | 0,87              | 1 144 000 4.625% United States Treasury Note/Bond 28/02/2025 | 1 155 127        | 1,22              |
| 574 000 2.125% United States Treasury Note/Bond 30/09/2024   | 555 793          | 0,59              | 1 377 000 1.750% United States Treasury Note/Bond 15/03/2025 | 1 317 079        | 1,39              |
| 1 126 000 4.250% United States Treasury Note/Bond 30/09/2024 | 1 124 724        | 1,18              | 1 131 000 0.500% United States Treasury Note/Bond 31/03/2025 | 1 054 878        | 1,11              |
| 1 584 000 0.625% United States Treasury Note/Bond 15/10/2024 | 1 497 994        | 1,58              | 506 000 2.625% United States Treasury Note/Bond 31/03/2025   | 492 382          | 0,52              |
| 784 000 1.500% United States Treasury Note/Bond 31/10/2024   | 750 833          | 0,79              |  |                  |                   |

## SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation | Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---------------|---|------------------|-------------------|
|               | <b>Valeurs mobilières – 99,39 % (mars 2022 : 99,54 %) (suite)</b> |                  |                   |
|               | <b>Obligations d'État – 99,39 % (mars 2022 : 99,54 %) (suite)</b> |                  |                   |
|               | <b>Dollar américain – 99,39 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 1 200 000     | 3.875% United States Treasury Note/Bond 31/03/2025                | 1 196 016        | 1,26              |
| 1 302 000     | 2.625% United States Treasury Note/Bond 15/04/2025                | 1 265 280        | 1,33              |
| 1 176 000     | 0.375% United States Treasury Note/Bond 30/04/2025                | 1 090 740        | 1,15              |
| 647 000       | 2.875% United States Treasury Note/Bond 30/04/2025                | 631 684          | 0,66              |
| 1 310 000     | 2.125% United States Treasury Note/Bond 15/05/2025                | 1 259 442        | 1,33              |
| 1 270 000     | 2.750% United States Treasury Note/Bond 15/05/2025                | 1 236 861        | 1,30              |
| 917 000       | 0.250% United States Treasury Note/Bond 31/05/2025                | 846 219          | 0,89              |
| 657 000       | 2.875% United States Treasury Note/Bond 31/05/2025                | 641 345          | 0,68              |
| 1 154 000     | 2.875% United States Treasury Note/Bond 15/06/2025                | 1 126 863        | 1,19              |
| 1 171 000     | 0.250% United States Treasury Note/Bond 30/06/2025                | 1 079 333        | 1,14              |
| 487 000       | 2.750% United States Treasury Note/Bond 30/06/2025                | 473 912          | 0,50              |
| 1 179 000     | 3.000% United States Treasury Note/Bond 15/07/2025                | 1 153 762        | 1,21              |
| 1 125 000     | 0.250% United States Treasury Note/Bond 31/07/2025                | 1 033 066        | 1,09              |
| 570 000       | 2.875% United States Treasury Note/Bond 31/07/2025                | 556 596          | 0,59              |
| 1 440 000     | 2.000% United States Treasury Note/Bond 15/08/2025                | 1 377 900        | 1,45              |
| 1 238 000     | 3.125% United States Treasury Note/Bond 15/08/2025                | 1 214 788        | 1,28              |
| 150 000       | 6.875% United States Treasury Note/Bond 15/08/2025                | 159 645          | 0,17              |
| 1 179 000     | 0.250% United States Treasury Note/Bond 31/08/2025                | 1 080 075        | 1,14              |
| 570 000       | 2.750% United States Treasury Note/Bond 31/08/2025                | 554 280          | 0,58              |
| 1 160 000     | 3.500% United States Treasury Note/Bond 15/09/2025                | 1 148 944        | 1,21              |
| 1 385 000     | 0.250% United States Treasury Note/Bond 30/09/2025                | 1 267 491        | 1,33              |
| 540 000       | 3.000% United States Treasury Note/Bond 30/09/2025                | 528 103          | 0,56              |
| 1 026 000     | 4.250% United States Treasury Note/Bond 15/10/2025                | 1 034 096        | 1,09              |
| 1 479 000     | 0.250% United States Treasury Note/Bond 31/10/2025                | 1 348 548        | 1,42              |
| 522 000       | 3.000% United States Treasury Note/Bond 31/10/2025                | 510 418          | 0,54              |

| Participation | Investissement  | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---------------|---|-------------------|-------------------|
|               | <b>Valeurs mobilières – 99,39 % (mars 2022 : 99,54 %) (suite)</b> |                   |                   |
|               | <b>Obligations d'État – 99,39 % (mars 2022 : 99,54 %) (suite)</b> |                   |                   |
|               | <b>Dollar américain – 99,39 % (suite)</b>                         |                   |                   |
| 1 615 000     | 4.000% United States Treasury Note/Bond 15/11/2025                | 1 549 895         | 1,63              |
| 1 071 000     | 4.500% United States Treasury Note/Bond 15/11/2025                | 1 086 898         | 1,14              |
| 1 250 000     | 0.375% United States Treasury Note/Bond 30/11/2025                | 1 140 234         | 1,20              |
| 652 000       | 2.875% United States Treasury Note/Bond 30/11/2025                | 635 394           | 0,67              |
| 1 075 000     | 4.000% United States Treasury Note/Bond 30/11/2025                | 1 079 115         | 1,14              |
| 1 504 000     | 0.375% United States Treasury Note/Bond 31/12/2025                | 1 370 873         | 1,44              |
| 590 000       | 2.625% United States Treasury Note/Bond 31/12/2025                | 570 917           | 0,60              |
| 1 104 000     | 3.875% United States Treasury Note/Bond 15/01/2026                | 1 104 431         | 1,16              |
| 1 573 000     | 0.375% United States Treasury Note/Bond 31/01/2026                | 1 427 989         | 1,50              |
| 775 000       | 2.625% United States Treasury Note/Bond 31/01/2026                | 749 691           | 0,79              |
| 1 444 000     | 1.625% United States Treasury Note/Bond 15/02/2026                | 1 358 037         | 1,43              |
| 1 100 000     | 4.000% United States Treasury Note/Bond 15/02/2026                | 1 104 641         | 1,16              |
| 1 800 000     | 0.500% United States Treasury Note/Bond 28/02/2026                | 1 635 891         | 1,72              |
| 900 000       | 2.500% United States Treasury Note/Bond 28/02/2026                | 867 094           | 0,91              |
| 1 000 000     | 4.625% United States Treasury Note/Bond 15/03/2026                | 1 022 461         | 1,08              |
| 1 000 000     | 0.750% United States Treasury Note/Bond 31/03/2026                | 915 547           | 0,96              |
| 1 000 000     | 2.250% United States Treasury Note/Bond 31/03/2026                | 956 914           | 1,01              |
|               | <b>Total des obligations d'État</b>                               | <b>94 418 076</b> | <b>99,39</b>      |
|               | <b>Total des valeurs mobilières</b>                               | <b>94 418 076</b> | <b>99,39</b>      |

|   | Juste valeur USD  | % du Comp.    |
|---|-------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | 94 418 076        | 99,39         |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,20 %)</b>                               | 171 855           | 0,18          |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : 0,26 %)</b>                                      | 409 833           | 0,43          |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>94 999 764</b> | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company.

## SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

|   | <b>% du<br/>total<br/>des actifs</b> |
|---|--------------------------------------|
| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                        |                                      |
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs | 83,69                                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé             | 11,13                                |
| Autres actifs   | <u>5,18</u>                          |
| <b>Total des actifs</b>   | <b><u>100,00</u></b>                 |



## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD        | 2022<br>USD       |
|---|-------|--------------------|-------------------|
| <b>Actifs circulants</b>  |       |                    |                   |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :            |       |                    |                   |
| Valeurs mobilières  | 1(e)  | 159 368 583        | 69 753 080        |
|   |       | <b>159 368 583</b> | <b>69 753 080</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie   | 1(f)  | 1 115 843          | 382 391           |
| Créances :  |       |                    |                   |
| Intérêts à recevoir   |       | 1 448 977          | 585 698           |
| À recevoir sur cessions d'investissements   |       | 69 225             | -                 |
| À recevoir sur cessions d'actions de fonds  |       | 2 628 898          | -                 |
| <b>Total des actifs circulants</b>  |       | <b>164 631 526</b> | <b>70 721 169</b> |
| <b>Passifs circulants</b>   |       |                    |                   |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :  |       |                    |                   |
| Charges à payer   |       | (15 942)           | (7 147)           |
| À payer sur achats d'investissements  |       | (2 719 536)        | (64 880)          |
| À payer sur rachats d'actions de fonds  |       | (822 590)          | -                 |
| <b>Total des passifs circulants</b>   |       | <b>(3 558 068)</b> | <b>(72 027)</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> |       | <b>161 073 458</b> | <b>70 649 142</b> |
|   |       | <b>2023</b>        | <b>2022</b>       |
|   |       | <b>2021</b>        |                   |
| Valeur liquidative par action   | 5     | 29,21 USD          | 30,77 USD         |
|   |       |                    | 32,83 USD         |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD        | 2022<br>USD        |
|---|-------|--------------------|--------------------|
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 3 840 826          | 1 710 416          |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 9     | (3 180 292)        | (4 598 299)        |
| Produits divers   |       | 12 891             | 98                 |
| <b>Total des produits/(charges) d'investissement</b>  |       | <b>673 425</b>     | <b>(2 887 785)</b> |
| Charges opérationnelles   | 3     | (121 534)          | (88 052)           |
| <b>Bénéfice/(Perte) net(te) pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>                               |       | <b>551 891</b>     | <b>(2 975 837)</b> |
| <b>Charges financières</b>  |       |                    |                    |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables   | 7     | (3 783 692)        | (1 676 230)        |
| <b>Perte pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(3 231 801)</b> | <b>(4 652 067)</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement   | 2     | (251)              | -                  |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(3 232 052)</b> | <b>(4 652 067)</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>USD        | 2022<br>USD        |
|---|--------------------|--------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier               | 70 649 142         | 70 748 066         |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(3 232 052)</b> | <b>(4 652 067)</b> |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                    |                    |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 154 682 018        | 18 114 807         |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (61 025 650)       | (13 561 664)       |
| Augmentation des actifs nets résultant d'opérations sur actions   | 93 656 368         | 4 553 143          |
| <b>Augmentation/(Diminution) totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>    | <b>90 424 316</b>  | <b>(98 924)</b>    |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>        | <b>161 073 458</b> | <b>70 649 142</b>  |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD         | 2022<br>USD        |
|---|-------|---------------------|--------------------|
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(3 232 052)</b>  | <b>(4 652 067)</b> |
| <b>Ajustement pour :</b>  |       |                     |                    |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  |       | (87 030 072)        | 323 189            |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   |       | <b>(90 262 124)</b> | <b>(4 328 878)</b> |
| Variation des montants à recevoir   |       | (863 279)           | (24 673)           |
| Variation des montants à payer  |       | 8 795               | (1 549)            |
| <b>Sorties de trésorerie sur opérations</b>   |       | <b>(854 484)</b>    | <b>(26 222)</b>    |
| <b>Sorties de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  |       | <b>(91 116 608)</b> | <b>(4 355 100)</b> |
| <b>Activités de financement</b>   |       |                     |                    |
| Produits des souscriptions  | 5     | 152 053 120         | 18 114 807         |
| Paiements sur rachats   | 5     | (60 203 060)        | (13 561 664)       |
| <b>Trésorerie nette générée sur activités de financement</b>  |       | <b>91 850 060</b>   | <b>4 553 143</b>   |
| <b>Augmentation nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>   |       | <b>733 452</b>      | <b>198 043</b>     |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  |       | 382 391             | 184 348            |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   |       | <b>1 115 843</b>    | <b>382 391</b>     |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |       |                     |                    |
| Impôts payés  |       | (251)               | -                  |
| Intérêts reçus  |       | 2 691 512           | 2 236 152          |
| Distributions payées  |       | (3 783 692)         | (1 676 230)        |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %)</b>                           |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %)</b>               |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %)</b>                     |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 %</b>   |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 75 000 2.000% 3M Co 14/02/2025  | 71 485           | 0,04              | 25 000 1.375% AES Corp 15/01/2026                                       | 22 469           | 0,01              |
| 50 000 2.650% 3M Co 15/04/2025  | 47 896           | 0,03              | 25 000 1.125% Aflac Inc 15/03/2026                                      | 22 707           | 0,01              |
| 50 000 2.875% 3M Co 15/10/2027  | 46 839           | 0,03              | 15 000 3.600% Aflac Inc 01/04/2030                                      | 14 104           | 0,01              |
| 30 000 3.375% 3M Co 01/03/2029  | 28 285           | 0,02              | 50 000 2.100% Agilent Technologies Inc 04/06/2030                       | 41 792           | 0,03              |
| 42 000 3.050% 3M Co 15/04/2030  | 38 378           | 0,02              | 20 000 2.300% Agilent Technologies Inc 12/03/2031                       | 16 733           | 0,01              |
| 30 000 2.950% Abbott Laboratories 15/03/2025  | 29 318           | 0,02              | 15 000 2.000% Agree LP 15/06/2028                                       | 12 730           | 0,01              |
| 20 000 3.875% Abbott Laboratories 15/09/2025  | 19 798           | 0,01              | 50 000 6.875% Ahold Finance USA LLC 01/05/2029                          | 54 262           | 0,03              |
| 50 000 3.750% Abbott Laboratories 30/11/2026  | 49 611           | 0,03              | 25 000 3.250% Air Lease Corp 01/03/2025                                 | 23 945           | 0,01              |
| 20 000 1.400% Abbott Laboratories 30/06/2030  | 16 695           | 0,01              | 50 000 3.375% Air Lease Corp 01/07/2025                                 | 47 537           | 0,03              |
| 60 000 3.850% AbbVie Inc 15/06/2024   | 59 270           | 0,04              | 65 000 2.875% Air Lease Corp 15/01/2026                                 | 60 599           | 0,04              |
| 130 000 2.600% AbbVie Inc 21/11/2024  | 125 454          | 0,08              | 20 000 2.200% Air Lease Corp 15/01/2027                                 | 17 753           | 0,01              |
| 35 000 3.800% AbbVie Inc 15/03/2025   | 34 435           | 0,02              | 25 000 5.850% Air Lease Corp 15/12/2027                                 | 25 136           | 0,02              |
| 241 000 3.600% AbbVie Inc 14/05/2025  | 236 414          | 0,15              | 100 000 5.300% Air Lease Corp 01/02/2028                                | 98 788           | 0,06              |
| 163 000 3.200% AbbVie Inc 14/05/2026  | 157 362          | 0,10              | 195 000 4.625% Air Lease Corp 01/10/2028                                | 185 357          | 0,11              |
| 70 000 2.950% AbbVie Inc 21/11/2026   | 66 611           | 0,04              | 50 000 2.875% Air Lease Corp 15/01/2032                                 | 41 254           | 0,03              |
| 35 000 4.250% AbbVie Inc 14/11/2028   | 34 796           | 0,02              | 60 000 1.500% Air Products and Chemicals Inc 15/10/2025                 | 55 784           | 0,03              |
| 350 000 3.200% AbbVie Inc 21/11/2029  | 324 649          | 0,20              | 30 000 4.125% Aircastle Ltd 01/05/2024                                  | 29 325           | 0,02              |
| 120 000 3.400% Activision Blizzard Inc 15/09/2026                                   | 116 185          | 0,07              | 25 000 3.750% Alabama Power Co 01/09/2027                               | 24 329           | 0,01              |
| 10 000 1.350% Activision Blizzard Inc 15/09/2030                                    | 8 101            | 0,00              | 50 000 3.050% Alabama Power Co 15/03/2032                               | 44 091           | 0,03              |
| 50 000 2.150% Acuity Brands Lighting Inc 15/12/2030                                 | 40 738           | 0,03              | 50 000 3.940% Alabama Power Co 01/09/2032                               | 46 912           | 0,03              |
| 15 000 1.900% Adobe Inc 01/02/2025  | 14 354           | 0,01              | 20 000 4.650% Albemarle Corp 01/06/2027                                 | 19 679           | 0,01              |
| 115 000 3.250% Adobe Inc 01/02/2025   | 112 705          | 0,07              | 75 000 5.050% Albemarle Corp 01/06/2032                                 | 73 389           | 0,05              |
| 80 000 2.300% Adobe Inc 01/02/2030  | 71 002           | 0,04              | 20 000 3.450% Alexandria Real Estate Equities Inc 30/04/2025            | 19 176           | 0,01              |
| 50 000 3.900% Advance Auto Parts Inc 15/04/2030                                     | 45 495           | 0,03              | 100 000 3.800% Alexandria Real Estate Equities Inc 15/04/2026           | 96 221           | 0,06              |
| 45 000 3.829% Advocate Health & Hospitals Corp 15/08/2028                           | 43 372           | 0,03              | 20 000 3.950% Alexandria Real Estate Equities Inc 15/01/2027            | 19 259           | 0,01              |
| 30 000 5.500% Aegon NV 11/04/2048   | 28 364           | 0,02              | 50 000 3.375% Alexandria Real Estate Equities Inc 15/08/2031            | 43 930           | 0,03              |
| 30 000 3.950% AEP Texas Inc 01/06/2028  | 28 875           | 0,02              | 75 000 2.000% Alexandria Real Estate Equities Inc 18/05/2032            | 57 304           | 0,04              |
| 50 000 2.100% AEP Texas Inc 01/07/2030  | 41 474           | 0,03              | 30 000 3.600% Alibaba Group Holding Ltd 28/11/2024                      | 29 337           | 0,02              |
| 50 000 2.875% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 14/08/2024  | 47 773           | 0,03              | 80 000 3.400% Alibaba Group Holding Ltd 06/12/2027                      | 75 406           | 0,05              |
| 50 000 1.650% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 29/10/2024  | 46 692           | 0,03              | 130 000 2.125% Alibaba Group Holding Ltd 09/02/2031                     | 107 607          | 0,07              |
| 200 000 4.450% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 01/10/2025 | 193 506          | 0,12              | 30 000 3.550% Allegion US Holding Co Inc 01/10/2027                     | 28 228           | 0,02              |
| 200 000 4.450% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 03/04/2026 | 191 832          | 0,12              | 10 000 4.350% Allied World Assurance Co Holdings Ltd 29/10/2025         | 9 692            | 0,01              |
| 80 000 2.450% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 29/10/2026  | 71 798           | 0,04              | 60 000 0.750% Allstate Corp 15/12/2025                                  | 53 786           | 0,03              |
| 55 000 3.650% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 21/07/2027  | 50 666           | 0,03              | 40 000 5.250% Allstate Corp 30/03/2033                                  | 40 474           | 0,03              |
| 75 000 3.875% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 23/01/2028  | 69 097           | 0,04              |   |                  |                   |
| 140 000 3.300% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 30/01/2032 | 115 623          | 0,07              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 20 000 3.875% Ally Financial Inc 21/05/2024                             | 19 108           | 0,01              |
| 160 000 4.625% Ally Financial Inc 30/03/2025                            | 151 616          | 0,09              |
| 150 000 5.800% Ally Financial Inc 01/05/2025                            | 144 952          | 0,09              |
| 30 000 4.750% Ally Financial Inc 09/06/2027                             | 27 790           | 0,02              |
| 30 000 0.450% Alphabet Inc 15/08/2025                                   | 27 550           | 0,02              |
| 55 000 1.998% Alphabet Inc 15/08/2026                                   | 51 537           | 0,03              |
| 200 000 0.800% Alphabet Inc 15/08/2027                                  | 175 424          | 0,11              |
| 10 000 2.350% Altria Group Inc 06/05/2025                               | 9 498            | 0,01              |
| 62 000 4.400% Altria Group Inc 14/02/2026                               | 61 502           | 0,04              |
| 40 000 4.800% Altria Group Inc 14/02/2029                               | 39 719           | 0,02              |
| 100 000 3.400% Altria Group Inc 06/05/2030                              | 89 002           | 0,06              |
| 100 000 2.450% Altria Group Inc 04/02/2032                              | 78 720           | 0,05              |
| 70 000 2.730% Amazon.com Inc 13/04/2024                                 | 68 623           | 0,04              |
| 60 000 2.800% Amazon.com Inc 22/08/2024                                 | 58 705           | 0,04              |
| 20 000 3.800% Amazon.com Inc 05/12/2024                                 | 19 840           | 0,01              |
| 100 000 3.000% Amazon.com Inc 13/04/2025                                | 97 512           | 0,06              |
| 15 000 0.800% Amazon.com Inc 03/06/2025                                 | 13 956           | 0,01              |
| 50 000 4.600% Amazon.com Inc 01/12/2025                                 | 50 429           | 0,03              |
| 45 000 5.200% Amazon.com Inc 03/12/2025                                 | 45 891           | 0,03              |
| 75 000 1.000% Amazon.com Inc 12/05/2026                                 | 67 985           | 0,04              |
| 125 000 3.300% Amazon.com Inc 13/04/2027                                | 120 945          | 0,07              |
| 360 000 3.150% Amazon.com Inc 22/08/2027                                | 345 550          | 0,21              |
| 200 000 4.550% Amazon.com Inc 01/12/2027                                | 203 002          | 0,13              |
| 350 000 1.500% Amazon.com Inc 03/06/2030                                | 291 165          | 0,18              |
| 20 000 2.100% Amazon.com Inc 12/05/2031                                 | 17 091           | 0,01              |
| 120 000 3.600% Amazon.com Inc 13/04/2032                                | 113 792          | 0,07              |
| 50 000 4.700% Amazon.com Inc 01/12/2032                                 | 51 265           | 0,03              |
| 100 000 4.000% Amcor Flexibles North America Inc 17/05/2025             | 97 949           | 0,06              |
| 30 000 2.630% Amcor Flexibles North America Inc 19/06/2030              | 25 141           | 0,02              |
| 15 000 2.690% Amcor Flexibles North America Inc 25/05/2031              | 12 476           | 0,01              |
| 25 000 2.538% Amdocs Ltd 15/06/2030                                     | 21 056           | 0,01              |
| 47 000 3.650% Ameren Corp 15/02/2026                                    | 45 269           | 0,03              |
| 25 000 1.950% Ameren Corp 15/03/2027                                    | 22 423           | 0,01              |
| 70 000 3.500% Ameren Corp 15/01/2031                                    | 63 555           | 0,04              |
| 70 000 3.850% Ameren Illinois Co 01/09/2032                             | 66 261           | 0,04              |
| 60 000 3.625% America Movil SAB de CV 22/04/2029                        | 56 078           | 0,03              |
| 40 000 2.875% America Movil SAB de CV 07/05/2030                        | 35 306           | 0,02              |
| 70 000 4.700% America Movil SAB de CV 21/07/2032                        | 69 065           | 0,04              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>             |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 33 420 3.600% American Airlines 2015-2 Class AA Pass Through Trust 22/03/2029 | 30 506           | 0,02              |
| 42 600 3.650% American Airlines 2017-1 Class AA Pass Through Trust 15/02/2029 | 38 934           | 0,02              |
| 37 822 3.350% American Airlines 2017-2 Class AA Pass Through Trust 15/04/2031 | 33 731           | 0,02              |
| 50 000 1.000% American Electric Power Co Inc 01/11/2025                       | 45 429           | 0,03              |
| 25 000 5.750% American Electric Power Co Inc 01/11/2027                       | 25 984           | 0,02              |
| 15 000 4.300% American Electric Power Co Inc 01/12/2028                       | 14 650           | 0,01              |
| 65 000 5.625% American Electric Power Co Inc 01/03/2033                       | 67 367           | 0,04              |
| 65 000 3.000% American Express Co 30/10/2024                                  | 63 393           | 0,04              |
| 40 000 2.250% American Express Co 04/03/2025                                  | 38 178           | 0,02              |
| 50 000 3.950% American Express Co 01/08/2025                                  | 49 054           | 0,03              |
| 40 000 4.200% American Express Co 06/11/2025                                  | 39 626           | 0,02              |
| 277 000 3.125% American Express Co 20/05/2026                                 | 264 131          | 0,16              |
| 20 000 1.650% American Express Co 04/11/2026                                  | 17 943           | 0,01              |
| 215 000 2.550% American Express Co 04/03/2027                                 | 199 000          | 0,12              |
| 30 000 3.300% American Express Co 03/05/2027                                  | 28 538           | 0,02              |
| 15 000 5.850% American Express Co 05/11/2027                                  | 15 753           | 0,01              |
| 65 000 4.989% American Express Co 26/05/2033                                  | 63 888           | 0,04              |
| 50 000 5.250% American Financial Group Inc/OH 02/04/2030                      | 50 609           | 0,03              |
| 20 000 4.250% American Homes 4 Rent LP 15/02/2028                             | 18 739           | 0,01              |
| 50 000 4.900% American Homes 4 Rent LP 15/02/2029                             | 48 151           | 0,03              |
| 15 000 3.625% American Homes 4 Rent LP 15/04/2032                             | 13 002           | 0,01              |
| 50 000 0.550% American Honda Finance Corp 12/07/2024                          | 47 405           | 0,03              |
| 20 000 0.750% American Honda Finance Corp 09/08/2024                          | 18 956           | 0,01              |
| 25 000 1.200% American Honda Finance Corp 08/07/2025                          | 23 180           | 0,01              |
| 70 000 1.000% American Honda Finance Corp 10/09/2025                          | 64 253           | 0,04              |
| 250 000 1.300% American Honda Finance Corp 09/09/2026                         | 224 480          | 0,14              |
| 17 000 2.500% American International Group Inc 30/06/2025                     | 16 094           | 0,01              |
| 20 000 3.400% American International Group Inc 30/06/2030                     | 17 926           | 0,01              |
| 35 000 5.125% American International Group Inc 27/03/2033                     | 34 806           | 0,02              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 5.750% American International Group Inc 01/04/2048               | 45 435           | 0,03              |
| 10 000 2.950% American Tower Corp 15/01/2025                            | 9 627            | 0,01              |
| 129 000 4.400% American Tower Corp 15/02/2026                           | 127 162          | 0,08              |
| 140 000 2.750% American Tower Corp 15/01/2027                           | 129 079          | 0,08              |
| 50 000 3.550% American Tower Corp 15/07/2027                            | 47 131           | 0,03              |
| 30 000 3.600% American Tower Corp 15/01/2028                            | 28 176           | 0,02              |
| 25 000 5.500% American Tower Corp 15/03/2028                            | 25 526           | 0,02              |
| 75 000 3.950% American Tower Corp 15/03/2029                            | 70 197           | 0,04              |
| 50 000 3.800% American Tower Corp 15/08/2029                            | 46 482           | 0,03              |
| 10 000 2.900% American Tower Corp 15/01/2030                            | 8 699            | 0,01              |
| 50 000 1.875% American Tower Corp 15/10/2030                            | 39 671           | 0,02              |
| 50 000 2.300% American Tower Corp 15/09/2031                            | 40 087           | 0,02              |
| 20 000 4.050% American Tower Corp 15/03/2032                            | 18 306           | 0,01              |
| 200 000 3.450% American Water Capital Corp 01/06/2029                   | 187 854          | 0,12              |
| 10 000 3.700% Ameriprise Financial Inc 15/10/2024                       | 9 788            | 0,01              |
| 50 000 4.500% Ameriprise Financial Inc 13/05/2032                       | 48 033           | 0,03              |
| 30 000 2.800% AmerisourceBergen Corp 15/05/2030                         | 26 322           | 0,02              |
| 100 000 2.700% AmerisourceBergen Corp 15/03/2031                        | 85 725           | 0,05              |
| 40 000 3.125% Amgen Inc 01/05/2025                                      | 38 828           | 0,02              |
| 50 000 5.507% Amgen Inc 02/03/2026                                      | 50 238           | 0,03              |
| 30 000 2.600% Amgen Inc 19/08/2026                                      | 28 241           | 0,02              |
| 40 000 2.200% Amgen Inc 21/02/2027                                      | 36 858           | 0,02              |
| 100 000 3.200% Amgen Inc 02/11/2027                                     | 94 741           | 0,06              |
| 100 000 5.150% Amgen Inc 02/03/2028                                     | 102 122          | 0,06              |
| 100 000 1.650% Amgen Inc 15/08/2028                                     | 86 840           | 0,05              |
| 30 000 3.000% Amgen Inc 22/02/2029                                      | 27 578           | 0,02              |
| 140 000 4.050% Amgen Inc 18/08/2029                                     | 135 262          | 0,08              |
| 100 000 5.250% Amgen Inc 02/03/2030                                     | 102 172          | 0,06              |
| 50 000 2.300% Amgen Inc 25/02/2031                                      | 42 078           | 0,03              |
| 80 000 2.000% Amgen Inc 15/01/2032                                      | 65 168           | 0,04              |
| 30 000 3.350% Amgen Inc 22/02/2032                                      | 27 044           | 0,02              |
| 300 000 5.250% Amgen Inc 02/03/2033                                     | 308 109          | 0,19              |
| 140 000 2.200% Amphenol Corp 15/09/2031                                 | 116 235          | 0,07              |
| 20 000 3.500% Analog Devices Inc 05/12/2026                             | 19 407           | 0,01              |
| 5 000 3.450% Analog Devices Inc 15/06/2027                              | 4 804            | 0,00              |
| 50 000 1.700% Analog Devices Inc 01/10/2028                             | 43 464           | 0,03              |
| 100 000 2.100% Analog Devices Inc 01/10/2031                            | 84 187           | 0,05              |
| 50 000 0.947% Andrew W Mellon Foundation 01/08/2027                     | 43 690           | 0,03              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>                     |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>               |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 215 000 3.650% Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 01/02/2026 | 210 995          | 0,13              |
| 125 000 4.000% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 13/04/2028                          | 123 215          | 0,08              |
| 195 000 4.750% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 23/01/2029                          | 199 189          | 0,12              |
| 50 000 3.500% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 01/06/2030                           | 47 163           | 0,03              |
| 20 000 4.900% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 23/01/2031                           | 20 698           | 0,01              |
| 150 000 2.800% Aon Corp 15/05/2030  | 132 642          | 0,08              |
| 25 000 2.050% Aon Corp / Aon Global Holdings PLC 23/08/2031                           | 20 217           | 0,01              |
| 10 000 2.600% Aon Corp / Aon Global Holdings PLC 02/12/2031                           | 8 391            | 0,01              |
| 100 000 5.000% Aon Corp / Aon Global Holdings PLC 12/09/2032                          | 100 866          | 0,06              |
| 15 000 5.350% Aon Corp / Aon Global Holdings PLC 28/02/2033                           | 15 518           | 0,01              |
| 30 000 3.500% Aon Global Ltd 14/06/2024   | 29 447           | 0,02              |
| 150 000 3.400% Appalachian Power Co 01/06/2025  | 145 306          | 0,09              |
| 25 000 2.700% Appalachian Power Co 01/04/2031   | 21 233           | 0,01              |
| 230 000 3.450% Apple Inc 06/05/2024   | 227 364          | 0,14              |
| 150 000 1.800% Apple Inc 11/09/2024   | 144 676          | 0,09              |
| 53 000 2.500% Apple Inc 09/02/2025  | 51 418           | 0,03              |
| 90 000 3.200% Apple Inc 13/05/2025  | 88 298           | 0,05              |
| 80 000 0.700% Apple Inc 08/02/2026  | 72 783           | 0,05              |
| 135 000 3.250% Apple Inc 23/02/2026   | 132 107          | 0,08              |
| 20 000 2.450% Apple Inc 04/08/2026  | 19 047           | 0,01              |
| 105 000 3.350% Apple Inc 09/02/2027   | 102 499          | 0,06              |
| 50 000 3.200% Apple Inc 11/05/2027  | 48 723           | 0,03              |
| 150 000 2.900% Apple Inc 12/09/2027   | 143 568          | 0,09              |
| 200 000 3.000% Apple Inc 13/11/2027   | 192 016          | 0,12              |
| 100 000 1.400% Apple Inc 05/08/2028   | 87 640           | 0,05              |
| 30 000 3.250% Apple Inc 08/08/2029  | 28 703           | 0,02              |
| 180 000 2.200% Apple Inc 11/09/2029   | 161 071          | 0,10              |
| 75 000 1.650% Apple Inc 11/05/2030  | 63 822           | 0,04              |
| 110 000 1.250% Apple Inc 20/08/2030   | 90 092           | 0,06              |
| 45 000 1.700% Apple Inc 05/08/2031  | 37 424           | 0,02              |
| 100 000 3.350% Apple Inc 08/08/2032   | 94 414           | 0,06              |
| 73 000 3.300% Applied Materials Inc 01/04/2027  | 70 523           | 0,04              |
| 40 000 1.750% Applied Materials Inc 01/06/2030  | 33 599           | 0,02              |
| 15 000 3.600% AptarGroup Inc 15/03/2032   | 13 226           | 0,01              |
| 50 000 2.396% Aptiv PLC / Aptiv Corp 18/02/2025                                       | 47 602           | 0,03              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 25 000 6.550% ArcelorMittal SA 29/11/2027                               | 26 066           | 0,02              |
| 100 000 6.800% ArcelorMittal SA 29/11/2032                              | 104 958          | 0,07              |
| 70 000 2.500% Archer-Daniels-Midland Co 11/08/2026                      | 66 039           | 0,04              |
| 50 000 2.900% Archer-Daniels-Midland Co 01/03/2032                      | 44 403           | 0,03              |
| 15 000 4.200% Ares Capital Corp 10/06/2024                              | 14 522           | 0,01              |
| 110 000 3.875% Ares Capital Corp 15/01/2026                             | 101 428          | 0,06              |
| 120 000 2.150% Ares Capital Corp 15/07/2026                             | 102 875          | 0,06              |
| 50 000 2.875% Ares Capital Corp 15/06/2027                              | 43 014           | 0,03              |
| 30 000 2.600% Arizona Public Service Co 15/08/2029                      | 26 074           | 0,02              |
| 30 000 2.200% Arizona Public Service Co 15/12/2031                      | 23 839           | 0,01              |
| 40 000 6.125% Arrow Electronics Inc 01/03/2026                          | 40 082           | 0,02              |
| 65 000 5.500% Arthur J Gallagher & Co 02/03/2033                        | 66 299           | 0,04              |
| 10 000 2.532% Ascension Health 15/11/2029                               | 8 782            | 0,01              |
| 5 000 4.900% Assurant Inc 27/03/2028                                    | 4 909            | 0,00              |
| 30 000 3.700% Assurant Inc 22/02/2030                                   | 26 576           | 0,02              |
| 60 000 0.700% Astrazeneca Finance LLC 28/05/2024                        | 57 368           | 0,04              |
| 75 000 1.200% Astrazeneca Finance LLC 28/05/2026                        | 68 309           | 0,04              |
| 100 000 1.750% Astrazeneca Finance LLC 28/05/2028                       | 88 721           | 0,05              |
| 5 000 2.250% Astrazeneca Finance LLC 28/05/2031                         | 4 297            | 0,00              |
| 130 000 3.375% AstraZeneca PLC 16/11/2025                               | 127 447          | 0,08              |
| 20 000 3.125% AstraZeneca PLC 12/06/2027                                | 19 096           | 0,01              |
| 30 000 4.000% AstraZeneca PLC 17/01/2029                                | 29 563           | 0,02              |
| 100 000 1.375% AstraZeneca PLC 06/08/2030                               | 81 547           | 0,05              |
| 100 000 1.700% AT&T Inc 25/03/2026                                      | 91 783           | 0,06              |
| 348 000 2.300% AT&T Inc 01/06/2027                                      | 318 848          | 0,20              |
| 25 000 1.650% AT&T Inc 01/02/2028                                       | 21 953           | 0,01              |
| 200 000 4.100% AT&T Inc 15/02/2028                                      | 195 304          | 0,12              |
| 100 000 4.350% AT&T Inc 01/03/2029                                      | 97 922           | 0,06              |
| 140 000 4.300% AT&T Inc 15/02/2030                                      | 136 132          | 0,08              |
| 50 000 2.750% AT&T Inc 01/06/2031                                       | 43 041           | 0,03              |
| 50 000 2.250% AT&T Inc 01/02/2032                                       | 40 833           | 0,03              |
| 10 000 4.125% Athene Holding Ltd 12/01/2028                             | 9 072            | 0,01              |
| 45 000 6.150% Athene Holding Ltd 03/04/2030                             | 44 950           | 0,03              |
| 70 000 3.500% Athene Holding Ltd 15/01/2031                             | 58 344           | 0,04              |
| 20 000 2.300% Atlantic City Electric Co 15/03/2031                      | 16 876           | 0,01              |
| 50 000 3.000% Atmos Energy Corp 15/06/2027                              | 47 240           | 0,03              |

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>                |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>          |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 5.088% Australia & New Zealand Banking Group Ltd/New York NY 08/12/2025  | 100 871          | 0,06              |
| 10 000 4.375% Autodesk Inc 15/06/2025  | 9 898            | 0,01              |
| 30 000 3.500% Autodesk Inc 15/06/2027  | 28 770           | 0,02              |
| 15 000 2.850% Autodesk Inc 15/01/2030  | 13 242           | 0,01              |
| 20 000 3.375% Automatic Data Processing Inc 15/09/2025                           | 19 619           | 0,01              |
| 10 000 1.700% Automatic Data Processing Inc 15/05/2028                           | 8 930            | 0,01              |
| 130 000 1.250% Automatic Data Processing Inc 01/09/2030                          | 106 566          | 0,07              |
| 10 000 1.950% AutoNation Inc 01/08/2028  | 8 311            | 0,01              |
| 100 000 2.400% AutoNation Inc 01/08/2031   | 76 810           | 0,05              |
| 150 000 3.850% AutoNation Inc 01/03/2032   | 127 827          | 0,08              |
| 10 000 3.125% AutoZone Inc 18/04/2024  | 9 763            | 0,01              |
| 50 000 3.250% AutoZone Inc 15/04/2025  | 48 367           | 0,03              |
| 40 000 3.750% AutoZone Inc 18/04/2029  | 37 615           | 0,02              |
| 45 000 4.000% AutoZone Inc 15/04/2030  | 42 776           | 0,03              |
| 65 000 4.750% AutoZone Inc 01/02/2033  | 64 214           | 0,04              |
| 125 000 3.200% AvalonBay Communities Inc 15/01/2028                              | 116 672          | 0,07              |
| 30 000 2.300% AvalonBay Communities Inc 01/03/2030                               | 25 475           | 0,02              |
| 100 000 2.050% AvalonBay Communities Inc 15/01/2032                              | 80 399           | 0,05              |
| 20 000 3.150% Avangrid Inc 01/12/2024  | 19 385           | 0,01              |
| 25 000 3.200% Avangrid Inc 15/04/2025  | 23 971           | 0,01              |
| 80 000 4.875% Avery Dennison Corp 06/12/2028                                     | 79 530           | 0,05              |
| 125 000 5.750% Avery Dennison Corp 15/03/2033                                    | 130 280          | 0,08              |
| 50 000 4.625% Avnet Inc 15/04/2026   | 49 261           | 0,03              |
| 75 000 6.250% Avnet Inc 15/03/2028   | 76 316           | 0,05              |
| 25 000 3.000% Avnet Inc 15/05/2031   | 20 141           | 0,01              |
| 40 000 3.900% AXIS Specialty Finance LLC 15/07/2029                              | 37 510           | 0,02              |
| 30 000 4.900% AXIS Specialty Finance LLC 15/01/2040                              | 23 866           | 0,01              |
| 50 000 4.375% Baidu Inc 14/05/2024   | 49 620           | 0,03              |
| 60 000 3.075% Baidu Inc 07/04/2025   | 57 663           | 0,04              |
| 100 000 2.375% Baidu Inc 23/08/2031  | 82 349           | 0,05              |
| 15 000 2.950% Bain Capital Specialty Finance Inc 10/03/2026                      | 13 267           | 0,01              |
| 20 000 2.550% Bain Capital Specialty Finance Inc 13/10/2026                      | 16 896           | 0,01              |
| 25 000 2.061% Baker Hughes Holdings LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc 15/12/2026 | 22 668           | 0,01              |
| 80 000 3.337% Baker Hughes Holdings LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc 15/12/2027 | 74 969           | 0,05              |



## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 1.125% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 18/09/2025             | 45 219           | 0,03              |
| 30 000 2.706% Banco Santander SA 27/06/2024                             | 28 979           | 0,02              |
| 70 000 3.496% Banco Santander SA 24/03/2025                             | 67 254           | 0,04              |
| 20 000 5.179% Banco Santander SA 19/11/2025                             | 19 602           | 0,01              |
| 100 000 1.849% Banco Santander SA 25/03/2026                            | 89 563           | 0,06              |
| 20 000 4.250% Banco Santander SA 11/04/2027                             | 18 878           | 0,01              |
| 350 000 5.294% Banco Santander SA 18/08/2027                            | 344 767          | 0,21              |
| 100 000 1.722% Banco Santander SA 14/09/2027                            | 87 099           | 0,05              |
| 70 000 4.175% Banco Santander SA 24/03/2028                             | 65 654           | 0,04              |
| 50 000 3.306% Banco Santander SA 27/06/2029                             | 44 738           | 0,03              |
| 50 000 3.490% Banco Santander SA 28/05/2030                             | 43 815           | 0,03              |
| 120 000 4.200% Bank of America Corp 26/08/2024                          | 118 079          | 0,07              |
| 50 000 4.000% Bank of America Corp 22/01/2025                           | 48 959           | 0,03              |
| 80 000 3.950% Bank of America Corp 21/04/2025                           | 77 526           | 0,05              |
| 270 000 0.976% Bank of America Corp 22/04/2025                          | 257 242          | 0,16              |
| 148 000 3.841% Bank of America Corp 25/04/2025                          | 145 252          | 0,09              |
| 100 000 0.981% Bank of America Corp 25/09/2025                          | 93 393           | 0,06              |
| 152 000 3.093% Bank of America Corp 01/10/2025                          | 146 368          | 0,09              |
| 70 000 2.456% Bank of America Corp 22/10/2025                           | 66 683           | 0,04              |
| 30 000 3.366% Bank of America Corp 23/01/2026                           | 28 856           | 0,02              |
| 90 000 2.015% Bank of America Corp 13/02/2026                           | 84 372           | 0,05              |
| 60 000 4.450% Bank of America Corp 03/03/2026                           | 58 753           | 0,04              |
| 50 000 3.384% Bank of America Corp 02/04/2026                           | 47 983           | 0,03              |
| 170 000 1.319% Bank of America Corp 19/06/2026                          | 155 380          | 0,10              |
| 100 000 4.827% Bank of America Corp 22/07/2026                          | 98 803           | 0,06              |
| 20 000 6.220% Bank of America Corp 15/09/2026                           | 20 586           | 0,01              |
| 30 000 4.250% Bank of America Corp 22/10/2026                           | 29 096           | 0,02              |
| 35 000 1.197% Bank of America Corp 24/10/2026                           | 31 447           | 0,02              |
| 50 000 5.080% Bank of America Corp 20/01/2027                           | 49 891           | 0,03              |
| 50 000 1.658% Bank of America Corp 11/03/2027                           | 45 234           | 0,03              |
| 40 000 3.559% Bank of America Corp 23/04/2027                           | 38 124           | 0,02              |
| 300 000 1.734% Bank of America Corp 22/07/2027                          | 268 545          | 0,17              |
| 75 000 3.248% Bank of America Corp 21/10/2027                           | 70 675           | 0,04              |
| 180 000 4.183% Bank of America Corp 25/11/2027                          | 174 096          | 0,11              |
| 60 000 3.824% Bank of America Corp 20/01/2028                           | 57 228           | 0,04              |
| 100 000 2.551% Bank of America Corp 04/02/2028                          | 91 025           | 0,06              |
| 110 000 3.705% Bank of America Corp 24/04/2028                          | 104 061          | 0,06              |
| 300 000 4.376% Bank of America Corp 27/04/2028                          | 290 862          | 0,18              |
| 130 000 3.593% Bank of America Corp 21/07/2028                          | 122 217          | 0,08              |
| 100 000 4.948% Bank of America Corp 22/07/2028                          | 99 476           | 0,06              |
| 85 000 6.204% Bank of America Corp 10/11/2028                           | 88 858           | 0,06              |
| 144 000 3.419% Bank of America Corp 20/12/2028                          | 133 900          | 0,08              |
| 200 000 3.970% Bank of America Corp 05/03/2029                          | 189 426          | 0,12              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 20 000 2.087% Bank of America Corp 14/06/2029                           | 17 208           | 0,01              |
| 30 000 3.974% Bank of America Corp 07/02/2030                           | 28 092           | 0,02              |
| 200 000 3.194% Bank of America Corp 23/07/2030                          | 177 662          | 0,11              |
| 120 000 2.884% Bank of America Corp 22/10/2030                          | 104 359          | 0,06              |
| 100 000 2.496% Bank of America Corp 13/02/2031                          | 84 747           | 0,05              |
| 385 000 2.592% Bank of America Corp 29/04/2031                          | 326 083          | 0,20              |
| 200 000 1.898% Bank of America Corp 23/07/2031                          | 160 342          | 0,10              |
| 10 000 1.922% Bank of America Corp 24/10/2031                           | 7 985            | 0,00              |
| 130 000 2.687% Bank of America Corp 22/04/2032                          | 108 551          | 0,07              |
| 100 000 2.299% Bank of America Corp 21/07/2032                          | 80 579           | 0,05              |
| 50 000 2.572% Bank of America Corp 20/10/2032                           | 40 871           | 0,03              |
| 185 000 2.972% Bank of America Corp 04/02/2033                          | 155 914          | 0,10              |
| 280 000 4.571% Bank of America Corp 27/04/2033                          | 266 370          | 0,17              |
| 100 000 5.015% Bank of America Corp 22/07/2033                          | 98 778           | 0,06              |
| 50 000 2.482% Bank of America Corp 21/09/2036                           | 37 877           | 0,02              |
| 50 000 3.846% Bank of America Corp 08/03/2037                           | 42 924           | 0,03              |
| 10 000 2.500% Bank of Montreal 28/06/2024                               | 9 670            | 0,01              |
| 100 000 4.250% Bank of Montreal 14/09/2024                              | 98 757           | 0,06              |
| 100 000 5.200% Bank of Montreal 12/12/2024                              | 100 096          | 0,06              |
| 50 000 1.500% Bank of Montreal 10/01/2025                               | 47 018           | 0,03              |
| 95 000 1.850% Bank of Montreal 01/05/2025                               | 89 015           | 0,06              |
| 50 000 1.250% Bank of Montreal 15/09/2026                               | 44 207           | 0,03              |
| 75 000 0.949% Bank of Montreal 22/01/2027                               | 66 996           | 0,04              |
| 50 000 2.650% Bank of Montreal 08/03/2027                               | 46 213           | 0,03              |
| 100 000 5.203% Bank of Montreal 01/02/2028                              | 100 845          | 0,06              |
| 10 000 3.803% Bank of Montreal 15/12/2032                               | 8 978            | 0,01              |
| 25 000 3.088% Bank of Montreal 10/01/2037                               | 19 967           | 0,01              |
| 50 000 2.100% Bank of New York Mellon Corp 24/10/2024                   | 47 861           | 0,03              |
| 275 000 0.850% Bank of New York Mellon Corp 25/10/2024                  | 257 590          | 0,16              |
| 10 000 3.000% Bank of New York Mellon Corp 24/02/2025                   | 9 657            | 0,01              |
| 60 000 3.950% Bank of New York Mellon Corp 18/11/2025                   | 58 236           | 0,04              |
| 90 000 2.800% Bank of New York Mellon Corp 04/05/2026                   | 84 474           | 0,05              |
| 5 000 3.850% Bank of New York Mellon Corp 28/04/2028                    | 4 831            | 0,00              |
| 70 000 5.802% Bank of New York Mellon Corp 25/10/2028                   | 72 705           | 0,05              |
| 40 000 1.900% Bank of New York Mellon Corp 25/01/2029                   | 33 848           | 0,02              |
| 25 000 3.850% Bank of New York Mellon Corp 26/04/2029                   | 23 958           | 0,01              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets                          | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|--|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |  | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |  | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |  | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 105 000   | 4.596%           | Bank of New York Mellon Corp 26/07/2030    | 103 168   | 0,06             |                   |
| 60 000  | 2.500%           | Bank of New York Mellon Corp 26/01/2032    | 49 595  | 0,03             |                   |
| 50 000  | 4.289%           | Bank of New York Mellon Corp 13/06/2033    | 47 893  | 0,03             |                   |
| 86 000  | 5.834%           | Bank of New York Mellon Corp 25/10/2033    | 91 860  | 0,06             |                   |
| 25 000  | 4.706%           | Bank of New York Mellon Corp 01/02/2034    | 24 729  | 0,02             |                   |
| 50 000  | 0.700%           | Bank of Nova Scotia 15/04/2024             | 47 785  | 0,03             |                   |
| 40 000  | 0.650%           | Bank of Nova Scotia 31/07/2024             | 37 726  | 0,02             |                   |
| 25 000  | 2.200%           | Bank of Nova Scotia 03/02/2025             | 23 767  | 0,01             |                   |
| 50 000  | 3.450%           | Bank of Nova Scotia 11/04/2025             | 48 497  | 0,03             |                   |
| 10 000  | 1.300%           | Bank of Nova Scotia 11/06/2025             | 9 224   | 0,01             |                   |
| 77 000  | 4.500%           | Bank of Nova Scotia 16/12/2025             | 75 463  | 0,05             |                   |
| 125 000   | 4.750%           | Bank of Nova Scotia 02/02/2026             | 124 276   | 0,08             |                   |
| 105 000   | 1.050%           | Bank of Nova Scotia 02/03/2026             | 94 051  | 0,06             |                   |
| 50 000  | 2.700%           | Bank of Nova Scotia 03/08/2026             | 46 443  | 0,03             |                   |
| 20 000  | 1.950%           | Bank of Nova Scotia 02/02/2027             | 18 096  | 0,01             |                   |
| 100 000   | 4.850%           | Bank of Nova Scotia 01/02/2030             | 98 767  | 0,06             |                   |
| 100 000   | 2.150%           | Bank of Nova Scotia 01/08/2031             | 80 938  | 0,05             |                   |
| 30 000  | 2.450%           | Bank of Nova Scotia 02/02/2032             | 24 781  | 0,02             |                   |
| 110 000   | 4.588%           | Bank of Nova Scotia 04/05/2037             | 97 601  | 0,06             |                   |
| 10 000  | 2.338%           | Banner Health 01/01/2030                   | 8 649   | 0,01             |                   |
| 20 000  | 1.897%           | Banner Health 01/01/2031                   | 16 372  | 0,01             |                   |
| 40 000  | 3.650%           | Barclays PLC 16/03/2025                    | 38 165  | 0,02             |                   |
| 100 000   | 3.932%           | Barclays PLC 07/05/2025                    | 97 309  | 0,06             |                   |
| 50 000  | 4.375%           | Barclays PLC 12/01/2026                    | 48 415  | 0,03             |                   |
| 350 000   | 2.852%           | Barclays PLC 07/05/2026                    | 327 057   | 0,20             |                   |
| 75 000  | 5.200%           | Barclays PLC 12/05/2026                    | 71 791  | 0,04             |                   |
| 100 000   | 5.304%           | Barclays PLC 09/08/2026                    | 98 029  | 0,06             |                   |
| 100 000   | 7.325%           | Barclays PLC 02/11/2026                    | 102 839   | 0,06             |                   |
| 40 000  | 4.337%           | Barclays PLC 10/01/2028                    | 38 096  | 0,02             |                   |
| 200 000   | 5.501%           | Barclays PLC 09/08/2028                    | 198 640   | 0,12             |                   |
| 50 000  | 4.972%           | Barclays PLC 16/05/2029                    | 48 227  | 0,03             |                   |
| 20 000  | 5.088%           | Barclays PLC 20/06/2030                    | 18 647  | 0,01             |                   |
| 50 000  | 2.645%           | Barclays PLC 24/06/2031                    | 40 355  | 0,02             |                   |
| 30 000  | 2.667%           | Barclays PLC 10/03/2032                    | 23 681  | 0,01             |                   |
| 300 000   | 2.894%           | Barclays PLC 24/11/2032                    | 239 034   | 0,15             |                   |
| 50 000  | 2.789%           | BAT Capital Corp 06/09/2024                | 48 207  | 0,03             |                   |
| 30 000  | 3.215%           | BAT Capital Corp 06/09/2026                | 28 253  | 0,02             |                   |
| 90 000  | 4.700%           | BAT Capital Corp 02/04/2027                | 88 325  | 0,05             |                   |
| 205 000   | 3.557%           | BAT Capital Corp 15/08/2027                | 190 642   | 0,12             |                   |
| 50 000  | 2.259%           | BAT Capital Corp 25/03/2028                | 42 943  | 0,03             |                   |
| 180 000   | 3.462%           | BAT Capital Corp 06/09/2029                | 158 746   | 0,10             |                   |
| 110 000   | 4.906%           | BAT Capital Corp 02/04/2030                | 106 113   | 0,07             |                   |
| 25 000  | 4.742%           | BAT Capital Corp 16/03/2032                | 23 237  | 0,01             |                   |
| 40 000  | 1.668%           | BAT International Finance PLC 25/03/2026   | 36 430  | 0,02             |                   |
| 90 000  | 4.000%           | Baxalta Inc 23/06/2025                     | 88 110  | 0,05             |                   |
| 70 000  | 1.322%           | Baxter International Inc 29/11/2024        | 65 874  | 0,04             |                   |
| 28 000  | 2.600%           | Baxter International Inc 15/08/2026        | 26 116  | 0,02             |                   |
| 50 000  | 2.272%           | Baxter International Inc 01/12/2028        | 43 432  | 0,03             |                   |
| 20 000  | 1.730%           | Baxter International Inc 01/04/2031        | 15 638  | 0,01             |                   |
| 95 000  | 2.539%           | Baxter International Inc 01/02/2032        | 77 396  | 0,05             |                   |
| 50 000  | 1.777%           | Baylor Scott & White Holdings 15/11/2030   | 40 524  | 0,03             |                   |
| 19 000  | 3.363%           | Becton Dickinson and Co 06/06/2024         | 18 651  | 0,01             |                   |
| 10 000  | 3.734%           | Becton Dickinson and Co 15/12/2024         | 9 796   | 0,01             |                   |
| 20 000  | 4.693%           | Becton Dickinson and Co 13/02/2028         | 20 089  | 0,01             |                   |
| 60 000  | 1.957%           | Becton Dickinson and Co 11/02/2031         | 49 339  | 0,03             |                   |
| 130 000   | 4.298%           | Becton Dickinson and Co 22/08/2032         | 125 932   | 0,08             |                   |
| 110 000   | 3.500%           | Berkshire Hathaway Energy Co 01/02/2025    | 108 261   | 0,07             |                   |
| 70 000  | 3.250%           | Berkshire Hathaway Energy Co 15/04/2028    | 66 911  | 0,04             |                   |
| 40 000  | 1.650%           | Berkshire Hathaway Energy Co 15/05/2031    | 32 117  | 0,02             |                   |
| 30 000  | 2.300%           | Berkshire Hathaway Finance Corp 15/03/2027 | 28 503  | 0,02             |                   |
| 50 000  | 2.875%           | Berkshire Hathaway Finance Corp 15/03/2032 | 45 011  | 0,03             |                   |
| 75 000  | 3.125%           | Berkshire Hathaway Inc 15/03/2026          | 72 990  | 0,05             |                   |
| 70 000  | 1.570%           | Berry Global Inc 15/01/2026                | 63 595  | 0,04             |                   |
| 55 000  | 4.450%           | Best Buy Co Inc 01/10/2028                 | 54 358  | 0,03             |                   |
| 50 000  | 3.750%           | BGC Partners Inc 01/10/2024                | 47 913  | 0,03             |                   |
| 50 000  | 6.420%           | BHP Billiton Finance USA Ltd 01/03/2026    | 52 312  | 0,03             |                   |
| 60 000  | 4.900%           | BHP Billiton Finance USA Ltd 28/02/2033    | 61 050  | 0,04             |                   |
| 30 000  | 4.050%           | Biogen Inc 15/09/2025                      | 29 315  | 0,02             |                   |
| 150 000   | 2.250%           | Biogen Inc 01/05/2030                      | 126 247   | 0,08             |                   |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 90 000 1.037% Black Hills Corp 23/08/2024                               | 84 841           | 0,05              | 35 000 2.900% Boston Properties LP 15/03/2030                           | 27 030           | 0,02              |
| 70 000 3.150% Black Hills Corp 15/01/2027                               | 65 831           | 0,04              | 50 000 2.550% Boston Properties LP 01/04/2032                           | 35 586           | 0,02              |
| 50 000 3.200% BlackRock Inc 15/03/2027                                  | 48 161           | 0,03              | 30 000 1.900% Boston Scientific Corp 01/06/2025                         | 28 362           | 0,02              |
| 50 000 1.900% BlackRock Inc 28/01/2031                                  | 41 910           | 0,03              | 20 000 2.650% Boston Scientific Corp 01/06/2030                         | 17 675           | 0,01              |
| 50 000 2.100% BlackRock Inc 25/02/2032                                  | 41 782           | 0,03              | 80 000 3.796% BP Capital Markets America Inc 21/09/2025                 | 79 422           | 0,05              |
| 40 000 1.750% Blackstone Private Credit Fund 15/09/2024                 | 37 170           | 0,02              | 100 000 3.410% BP Capital Markets America Inc 11/02/2026                | 97 418           | 0,06              |
| 45 000 4.700% Blackstone Private Credit Fund 24/03/2025                 | 42 975           | 0,03              | 60 000 3.119% BP Capital Markets America Inc 04/05/2026                 | 57 728           | 0,04              |
| 70 000 2.625% Blackstone Private Credit Fund 15/12/2026                 | 58 852           | 0,04              | 50 000 3.588% BP Capital Markets America Inc 14/04/2027                 | 48 465           | 0,03              |
| 70 000 3.250% Blackstone Private Credit Fund 15/03/2027                 | 59 418           | 0,04              | 180 000 4.234% BP Capital Markets America Inc 06/11/2028                | 178 403          | 0,11              |
| 70 000 2.750% Blackstone Secured Lending Fund 16/09/2026                | 60 524           | 0,04              | 30 000 3.633% BP Capital Markets America Inc 06/04/2030                 | 28 514           | 0,02              |
| 50 000 2.125% Blackstone Secured Lending Fund 15/02/2027                | 41 401           | 0,03              | 180 000 2.721% BP Capital Markets America Inc 12/01/2032                | 157 084          | 0,10              |
| 10 000 5.250% Block Financial LLC 01/10/2025                            | 9 952            | 0,01              | 35 000 4.812% BP Capital Markets America Inc 13/02/2033                 | 35 540           | 0,02              |
| 10 000 2.500% Block Financial LLC 15/07/2028                            | 8 618            | 0,01              | 100 000 4.000% BPCE SA 15/04/2024                                       | 98 170           | 0,06              |
| 50 000 3.875% Block Financial LLC 15/08/2030                            | 43 221           | 0,03              | 25 000 4.100% Brandywine Operating Partnership LP 01/10/2024            | 23 275           | 0,01              |
| 30 000 5.950% Boardwalk Pipelines LP 01/06/2026                         | 30 468           | 0,02              | 20 000 7.550% Brandywine Operating Partnership LP 15/03/2028            | 17 925           | 0,01              |
| 30 000 4.450% Boardwalk Pipelines LP 15/07/2027                         | 29 298           | 0,02              | 20 000 4.550% Brandywine Operating Partnership LP 01/10/2029            | 14 925           | 0,01              |
| 150 000 4.800% Boardwalk Pipelines LP 03/05/2029                        | 147 097          | 0,09              | 20 000 3.700% Brighthouse Financial Inc 22/06/2027                      | 18 252           | 0,01              |
| 50 000 3.400% Boardwalk Pipelines LP 15/02/2031                         | 43 635           | 0,03              | 145 000 5.625% Brighthouse Financial Inc 15/05/2030                     | 139 504          | 0,09              |
| 55 000 4.875% Boeing Co 01/05/2025                                      | 54 892           | 0,03              | 77 000 2.900% Bristol-Myers Squibb Co 26/07/2024                        | 75 503           | 0,05              |
| 50 000 2.750% Boeing Co 01/02/2026                                      | 47 371           | 0,03              | 50 000 3.200% Bristol-Myers Squibb Co 15/06/2026                        | 48 352           | 0,03              |
| 455 000 2.196% Boeing Co 04/02/2026                                     | 422 063          | 0,26              | 150 000 3.450% Bristol-Myers Squibb Co 15/11/2027                       | 144 951          | 0,09              |
| 50 000 3.100% Boeing Co 01/05/2026                                      | 47 389           | 0,03              | 250 000 3.900% Bristol-Myers Squibb Co 20/02/2028                       | 245 317          | 0,15              |
| 100 000 2.700% Boeing Co 01/02/2027                                     | 92 238           | 0,06              | 65 000 3.400% Bristol-Myers Squibb Co 26/07/2029                        | 61 714           | 0,04              |
| 110 000 5.040% Boeing Co 01/05/2027                                     | 110 801          | 0,07              | 30 000 1.450% Bristol-Myers Squibb Co 13/11/2030                        | 24 533           | 0,02              |
| 100 000 3.450% Boeing Co 01/11/2028                                     | 92 472           | 0,06              | 20 000 5.125% British Telecommunications PLC 04/12/2028                 | 20 184           | 0,01              |
| 25 000 3.200% Boeing Co 01/03/2029                                      | 22 768           | 0,01              | 50 000 9.625% British Telecommunications PLC 15/12/2030                 | 62 559           | 0,04              |
| 70 000 2.950% Boeing Co 01/02/2030                                      | 61 659           | 0,04              | 15 000 4.125% Brixmor Operating Partnership LP 15/06/2026               | 14 191           | 0,01              |
| 50 000 5.150% Boeing Co 01/05/2030                                      | 50 317           | 0,03              |   |                  |                   |
| 36 000 3.464% Bon Secours Mercy Health Inc 01/06/2030                   | 32 352           | 0,02              |   |                  |                   |
| 30 000 3.650% Booking Holdings Inc 15/03/2025                           | 29 376           | 0,02              |   |                  |                   |
| 10 000 3.600% Booking Holdings Inc 01/06/2026                           | 9 751            | 0,01              |   |                  |                   |
| 115 000 4.625% Booking Holdings Inc 13/04/2030                          | 114 865          | 0,07              |   |                  |                   |
| 100 000 2.650% BorgWarner Inc 01/07/2027                                | 91 846           | 0,06              |   |                  |                   |
| 50 000 3.200% Boston Properties LP 15/01/2025                           | 46 411           | 0,03              |   |                  |                   |
| 130 000 4.500% Boston Properties LP 01/12/2028                          | 113 402          | 0,07              |   |                  |                   |
| 70 000 3.400% Boston Properties LP 21/06/2029                           | 57 107           | 0,04              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets                                      | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|--|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |  | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |  | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |  | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 235 000   | 4.125%           | Brixmor Operating Partnership LP 15/05/2029            | 214 367   | 0,13             |                   |
| 10 000  | 4.050%           | Brixmor Operating Partnership LP 01/07/2030            | 8 957   | 0,01             |                   |
| 320 000   | 3.875%           | Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 15/01/2027 | 309 411   | 0,19             |                   |
| 90 000  | 3.500%           | Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 15/01/2028 | 84 386  | 0,05             |                   |
| 30 000  | 3.150%           | Broadcom Inc 15/11/2025                                | 28 753  | 0,02             |                   |
| 40 000  | 3.459%           | Broadcom Inc 15/09/2026                                | 38 239  | 0,02             |                   |
| 50 000  | 4.110%           | Broadcom Inc 15/09/2028                                | 47 835  | 0,03             |                   |
| 40 000  | 4.750%           | Broadcom Inc 15/04/2029                                | 39 430  | 0,02             |                   |
| 80 000  | 5.000%           | Broadcom Inc 15/04/2030                                | 79 505  | 0,05             |                   |
| 78 000  | 4.150%           | Broadcom Inc 15/11/2030                                | 72 304  | 0,04             |                   |
| 80 000  | 4.300%           | Broadcom Inc 15/11/2032                                | 73 520  | 0,05             |                   |
| 70 000  | 3.400%           | Broadridge Financial Solutions Inc 27/06/2026          | 67 005  | 0,04             |                   |
| 25 000  | 2.600%           | Broadstone Net Lease LLC 15/09/2031                    | 17 997  | 0,01             |                   |
| 28 000  | 4.250%           | Brookfield Finance Inc 02/06/2026                      | 27 056  | 0,02             |                   |
| 100 000   | 3.900%           | Brookfield Finance Inc 25/01/2028                      | 92 639  | 0,06             |                   |
| 60 000  | 4.850%           | Brookfield Finance Inc 29/03/2029                      | 57 880  | 0,04             |                   |
| 5 000   | 4.500%           | Brown & Brown Inc 15/03/2029                           | 4 827   | 0,00             |                   |
| 100 000   | 2.375%           | Brown & Brown Inc 15/03/2031                           | 80 077  | 0,05             |                   |
| 15 000  | 4.200%           | Brown & Brown Inc 17/03/2032                           | 13 515  | 0,01             |                   |
| 20 000  | 4.750%           | Brown-Forman Corp 15/04/2033                           | 20 268  | 0,01             |                   |
| 20 000  | 2.400%           | Brunswick Corp/DE 18/08/2031                           | 15 154  | 0,01             |                   |
| 30 000  | 4.400%           | Brunswick Corp/DE 15/09/2032                           | 26 200  | 0,02             |                   |
| 15 000  | 1.630%           | Bunge Ltd Finance Corp 17/08/2025                      | 13 876  | 0,01             |                   |
| 30 000  | 3.250%           | Bunge Ltd Finance Corp 15/08/2026                      | 28 457  | 0,02             |                   |
| 55 000  | 2.750%           | Bunge Ltd Finance Corp 14/05/2031                      | 46 756  | 0,03             |                   |
| 100 000   | 3.000%           | Burlington Northern Santa Fe LLC 01/04/2025            | 97 427  | 0,06             |                   |
| 30 000  | 3.650%           | Burlington Northern Santa Fe LLC 01/09/2025            | 29 375  | 0,02             |                   |
| 10 000  | 3.250%           | Burlington Northern Santa Fe LLC 15/06/2027            | 9 657   | 0,01             |                   |
| 15 000  | 4.000%           | Cabot Corp 01/07/2029                                  | 14 011  | 0,01             |                   |
| 50 000  | 5.000%           | Cabot Corp 30/06/2032                                  | 48 780  | 0,03             |                   |
| 10 000  | 4.100%           | Camden Property Trust 15/10/2028                       | 9 668   | 0,01             |                   |
| 100 000   | 2.800%           | Camden Property Trust 15/05/2030                       | 86 600  | 0,05             |                   |
| 50 000  | 3.300%           | Campbell Soup Co 19/03/2025                            | 48 471  | 0,03             |                   |
| 40 000  | 4.150%           | Campbell Soup Co 15/03/2028                            | 39 182  | 0,02             |                   |
| 10 000  | 2.375%           | Campbell Soup Co 24/04/2030                            | 8 570   | 0,01             |                   |
| 75 000  | 2.250%           | Canadian Imperial Bank of Commerce 28/01/2025          | 71 319  | 0,04             |                   |
| 105 000   | 3.300%           | Canadian Imperial Bank of Commerce 07/04/2025          | 101 605   | 0,06             |                   |
| 75 000  | 1.250%           | Canadian Imperial Bank of Commerce 22/06/2026          | 67 092  | 0,04             |                   |
| 60 000  | 3.450%           | Canadian Imperial Bank of Commerce 07/04/2027          | 56 934  | 0,04             |                   |
| 30 000  | 3.600%           | Canadian Imperial Bank of Commerce 07/04/2032          | 27 303  | 0,02             |                   |
| 15 000  | 2.950%           | Canadian National Railway Co 21/11/2024                | 14 590  | 0,01             |                   |
| 10 000  | 6.900%           | Canadian National Railway Co 15/07/2028                | 11 155  | 0,01             |                   |
| 105 000   | 3.850%           | Canadian National Railway Co 05/08/2032                | 99 791  | 0,06             |                   |
| 80 000  | 3.850%           | Canadian Natural Resources Ltd 01/06/2027              | 76 586  | 0,05             |                   |
| 45 000  | 1.350%           | Canadian Pacific Railway Co 02/12/2024                 | 42 416  | 0,03             |                   |
| 90 000  | 1.750%           | Canadian Pacific Railway Co 02/12/2026                 | 81 752  | 0,05             |                   |
| 20 000  | 4.000%           | Canadian Pacific Railway Co 01/06/2028                 | 19 674  | 0,01             |                   |
| 50 000  | 2.050%           | Canadian Pacific Railway Co 05/03/2030                 | 42 490  | 0,03             |                   |
| 50 000  | 2.450%           | Canadian Pacific Railway Co 02/12/2031                 | 43 285  | 0,03             |                   |
| 90 000  | 3.300%           | Capital One Financial Corp 30/10/2024                  | 86 017  | 0,05             |                   |
| 50 000  | 3.200%           | Capital One Financial Corp 05/02/2025                  | 47 088  | 0,03             |                   |
| 200 000   | 3.750%           | Capital One Financial Corp 28/07/2026                  | 181 908   | 0,11             |                   |
| 120 000   | 3.750%           | Capital One Financial Corp 09/03/2027                  | 109 056   | 0,07             |                   |
| 50 000  | 3.650%           | Capital One Financial Corp 11/05/2027                  | 45 678  | 0,03             |                   |
| 25 000  | 1.878%           | Capital One Financial Corp 02/11/2027                  | 21 510  | 0,01             |                   |
| 70 000  | 3.800%           | Capital One Financial Corp 31/01/2028                  | 64 185  | 0,04             |                   |
| 25 000  | 4.927%           | Capital One Financial Corp 10/05/2028                  | 24 032  | 0,01             |                   |
| 95 000  | 5.468%           | Capital One Financial Corp 01/02/2029                  | 92 606  | 0,06             |                   |
| 25 000  | 3.273%           | Capital One Financial Corp 01/03/2030                  | 21 469  | 0,01             |                   |
| 25 000  | 5.247%           | Capital One Financial Corp 26/07/2030                  | 23 746  | 0,01             |                   |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 2.359% Capital One Financial Corp 29/07/2032                    | 71 391           | 0,04              |
| 25 000 2.618% Capital One Financial Corp 02/11/2032                     | 19 235           | 0,01              |
| 150 000 5.268% Capital One Financial Corp 10/05/2033                    | 140 818          | 0,09              |
| 30 000 3.500% Cardinal Health Inc 15/11/2024                            | 29 261           | 0,02              |
| 25 000 3.750% Cardinal Health Inc 15/09/2025                            | 24 401           | 0,02              |
| 50 000 3.410% Cardinal Health Inc 15/06/2027                            | 47 388           | 0,03              |
| 15 000 3.500% Carlisle Cos Inc 01/12/2024                               | 14 670           | 0,01              |
| 100 000 2.750% Carlisle Cos Inc 01/03/2030                              | 85 432           | 0,05              |
| 60 000 2.200% Carlisle Cos Inc 01/03/2032                               | 46 613           | 0,03              |
| 159 000 2.242% Carrier Global Corp 15/02/2025                           | 151 781          | 0,09              |
| 5 000 2.850% Caterpillar Financial Services Corp 17/05/2024             | 4 901            | 0,00              |
| 175 000 0.600% Caterpillar Financial Services Corp 13/09/2024           | 165 585          | 0,10              |
| 50 000 4.900% Caterpillar Financial Services Corp 17/01/2025            | 50 366           | 0,03              |
| 70 000 3.400% Caterpillar Financial Services Corp 13/05/2025            | 68 590           | 0,04              |
| 50 000 4.800% Caterpillar Financial Services Corp 06/01/2026            | 50 812           | 0,03              |
| 35 000 0.900% Caterpillar Financial Services Corp 02/03/2026            | 31 733           | 0,02              |
| 35 000 1.700% Caterpillar Financial Services Corp 08/01/2027            | 32 022           | 0,02              |
| 100 000 3.600% Caterpillar Financial Services Corp 12/08/2027           | 97 865           | 0,06              |
| 50 000 1.100% Caterpillar Financial Services Corp 14/09/2027            | 43 977           | 0,03              |
| 50 000 2.600% Caterpillar Inc 19/09/2029                                | 45 658           | 0,03              |
| 50 000 3.650% Cboe Global Markets Inc 12/01/2027                        | 48 343           | 0,03              |
| 75 000 3.000% Cboe Global Markets Inc 16/03/2032                        | 64 690           | 0,04              |
| 56 000 4.875% CBRE Services Inc 01/03/2026                              | 55 219           | 0,03              |
| 30 000 2.500% CBRE Services Inc 01/04/2031                              | 23 751           | 0,01              |
| 50 000 2.670% CDW LLC / CDW Finance Corp 01/12/2026                     | 45 512           | 0,03              |
| 70 000 4.250% CDW LLC / CDW Finance Corp 01/04/2028                     | 65 404           | 0,04              |
| 50 000 3.569% CDW LLC / CDW Finance Corp 01/12/2031                     | 43 019           | 0,03              |
| 20 000 3.500% Celanese US Holdings LLC 08/05/2024                       | 19 540           | 0,01              |
| 75 000 6.165% Celanese US Holdings LLC 15/07/2027                       | 75 822           | 0,05              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>   |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>                                   |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 200 000 6.330% Celanese US Holdings LLC 15/07/2029  | 202 592          | 0,13              |
| 115 000 6.379% Celanese US Holdings LLC 15/07/2032  | 116 605          | 0,07              |
| 50 000 3.875% Celulosa Arauco y Constitucion SA 02/11/2027  | 46 085           | 0,03              |
| 25 000 4.250% Cenovus Energy Inc 15/04/2027   | 24 300           | 0,01              |
| 275 000 4.625% Centene Corp 15/12/2029  | 258 720          | 0,16              |
| 130 000 3.375% Centene Corp 15/02/2030  | 113 851          | 0,07              |
| 50 000 3.000% Centene Corp 15/10/2030   | 42 082           | 0,03              |
| 160 000 2.625% Centene Corp 01/08/2031  | 129 702          | 0,08              |
| 60 000 2.400% CenterPoint Energy Houston Electric LLC 01/09/2026  | 55 873           | 0,03              |
| 50 000 3.000% CenterPoint Energy Houston Electric LLC 01/03/2032  | 44 319           | 0,03              |
| 10 000 4.450% CenterPoint Energy Houston Electric LLC 01/10/2032  | 9 909            | 0,01              |
| 100 000 5.250% CenterPoint Energy Resources Corp 01/03/2028   | 102 549          | 0,06              |
| 50 000 4.400% CenterPoint Energy Resources Corp 01/07/2032  | 48 562           | 0,03              |
| 70 000 2.300% CGI Inc 14/09/2031  | 55 512           | 0,03              |
| 10 000 4.200% CH Robinson Worldwide Inc 15/04/2028  | 9 668            | 0,01              |
| 80 000 3.750% Charles Schwab Corp 01/04/2024  | 78 579           | 0,05              |
| 255 000 3.625% Charles Schwab Corp 01/04/2025   | 245 450          | 0,15              |
| 30 000 3.450% Charles Schwab Corp 13/02/2026  | 28 345           | 0,02              |
| 50 000 0.900% Charles Schwab Corp 11/03/2026  | 43 875           | 0,03              |
| 50 000 2.450% Charles Schwab Corp 03/03/2027  | 44 883           | 0,03              |
| 20 000 3.200% Charles Schwab Corp 25/01/2028  | 18 301           | 0,01              |
| 60 000 3.250% Charles Schwab Corp 22/05/2029  | 53 428           | 0,03              |
| 50 000 2.900% Charles Schwab Corp 03/03/2032  | 41 718           | 0,03              |
| 153 000 4.908% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 23/07/2025 | 151 314          | 0,09              |
| 70 000 3.750% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 15/02/2028  | 64 902           | 0,04              |
| 50 000 2.250% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 15/01/2029  | 41 697           | 0,03              |
| 80 000 5.050% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 30/03/2029  | 77 269           | 0,05              |
| 100 000 2.800% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 01/04/2031 | 80 471           | 0,05              |
| 130 000 5.125% Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 30/06/2027  | 130 187          | 0,08              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>            |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>      |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                                    |                  |                   |
| 200 000 4.500% Cheniere Energy Partners LP 01/10/2029                        | 186 580          | 0,12              |
| 208 000 2.954% Chevron Corp 16/05/2026                                       | 200 341          | 0,12              |
| 50 000 1.995% Chevron Corp 11/05/2027  | 45 908           | 0,03              |
| 125 000 2.236% Chevron Corp 11/05/2030                                       | 110 531          | 0,07              |
| 65 000 0.687% Chevron USA Inc 12/08/2025                                     | 59 630           | 0,04              |
| 10 000 3.850% Chevron USA Inc 15/01/2028                                     | 9 878            | 0,01              |
| 20 000 3.350% Chubb INA Holdings Inc 15/05/2024                              | 19 673           | 0,01              |
| 120 000 3.350% Chubb INA Holdings Inc 03/05/2026                             | 116 269          | 0,07              |
| 30 000 1.375% Chubb INA Holdings Inc 15/09/2030                              | 24 264           | 0,01              |
| 5 000 3.150% Church & Dwight Co Inc 01/08/2027                               | 4 782            | 0,00              |
| 100 000 3.200% CI Financial Corp 17/12/2030                                  | 76 987           | 0,05              |
| 100 000 3.250% Cigna Group 15/04/2025  | 96 928           | 0,06              |
| 90 000 4.500% Cigna Group 25/02/2026   | 89 572           | 0,06              |
| 215 000 1.250% Cigna Group 15/03/2026  | 194 784          | 0,12              |
| 50 000 3.400% Cigna Group 01/03/2027   | 47 844           | 0,03              |
| 100 000 5.400% Cigna Group 15/03/2033  | 103 985          | 0,06              |
| 100 000 3.700% Cintas Corp No 2 01/04/2027                                   | 97 226           | 0,06              |
| 100 000 2.500% Cisco Systems Inc 20/09/2026                                  | 94 448           | 0,06              |
| 80 000 0.750% Citigroup Global Markets Holdings Inc/United States 07/06/2024 | 75 230           | 0,05              |
| 180 000 3.875% Citigroup Inc 26/03/2025                                      | 174 416          | 0,11              |
| 110 000 3.352% Citigroup Inc 24/04/2025                                      | 107 261          | 0,07              |
| 1 000 3.300% Citigroup Inc 27/04/2025  | 965              | 0,00              |
| 50 000 0.981% Citigroup Inc 01/05/2025                                       | 47 546           | 0,03              |
| 50 000 4.140% Citigroup Inc 24/05/2025                                       | 49 159           | 0,03              |
| 80 000 4.400% Citigroup Inc 10/06/2025                                       | 77 975           | 0,05              |
| 150 000 3.700% Citigroup Inc 12/01/2026                                      | 145 344          | 0,09              |
| 100 000 2.014% Citigroup Inc 25/01/2026                                      | 94 188           | 0,06              |
| 200 000 4.600% Citigroup Inc 09/03/2026                                      | 196 232          | 0,12              |
| 100 000 3.290% Citigroup Inc 17/03/2026                                      | 96 033           | 0,06              |
| 200 000 3.106% Citigroup Inc 08/04/2026                                      | 191 234          | 0,12              |
| 25 000 3.400% Citigroup Inc 01/05/2026                                       | 23 863           | 0,01              |
| 100 000 5.610% Citigroup Inc 29/09/2026                                      | 100 595          | 0,06              |
| 55 000 3.200% Citigroup Inc 21/10/2026                                       | 51 916           | 0,03              |
| 50 000 4.300% Citigroup Inc 20/11/2026                                       | 48 445           | 0,03              |
| 110 000 1.122% Citigroup Inc 28/01/2027                                      | 98 270           | 0,06              |
| 50 000 1.462% Citigroup Inc 09/06/2027                                       | 44 427           | 0,03              |
| 115 000 4.450% Citigroup Inc 29/09/2027                                      | 111 527          | 0,07              |
| 170 000 3.887% Citigroup Inc 10/01/2028                                      | 162 732          | 0,10              |
| 50 000 3.070% Citigroup Inc 24/02/2028                                       | 46 514           | 0,03              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 40 000 4.658% Citigroup Inc 24/05/2028                                  | 39 549           | 0,02              |
| 100 000 3.668% Citigroup Inc 24/07/2028                                 | 94 726           | 0,06              |
| 55 000 4.125% Citigroup Inc 25/07/2028                                  | 52 063           | 0,03              |
| 15 000 3.520% Citigroup Inc 27/10/2028                                  | 14 029           | 0,01              |
| 150 000 3.980% Citigroup Inc 20/03/2030                                 | 140 080          | 0,09              |
| 70 000 2.976% Citigroup Inc 05/11/2030                                  | 61 349           | 0,04              |
| 290 000 4.412% Citigroup Inc 31/03/2031                                 | 275 880          | 0,17              |
| 140 000 2.572% Citigroup Inc 03/06/2031                                 | 118 160          | 0,07              |
| 200 000 2.561% Citigroup Inc 01/05/2032                                 | 165 710          | 0,10              |
| 50 000 6.625% Citigroup Inc 15/06/2032                                  | 53 552           | 0,03              |
| 35 000 2.520% Citigroup Inc 03/11/2032                                  | 28 600           | 0,02              |
| 170 000 3.057% Citigroup Inc 25/01/2033                                 | 144 264          | 0,09              |
| 170 000 3.785% Citigroup Inc 17/03/2033                                 | 152 439          | 0,09              |
| 70 000 4.910% Citigroup Inc 24/05/2033                                  | 68 606           | 0,04              |
| 95 000 6.270% Citigroup Inc 17/11/2033                                  | 102 749          | 0,06              |
| 200 000 3.250% Citizens Financial Group Inc 30/04/2030                  | 165 754          | 0,10              |
| 50 000 3.743% Cleco Corporate Holdings LLC 01/05/2026                   | 47 509           | 0,03              |
| 50 000 4.400% Clorox Co 01/05/2029                                      | 49 425           | 0,03              |
| 25 000 4.600% Clorox Co 01/05/2032                                      | 24 830           | 0,02              |
| 30 000 3.000% CME Group Inc 15/03/2025                                  | 29 069           | 0,02              |
| 50 000 3.000% CMS Energy Corp 15/05/2026                                | 47 446           | 0,03              |
| 10 000 4.750% CMS Energy Corp 01/06/2050                                | 8 632            | 0,01              |
| 20 000 3.750% CMS Energy Corp 01/12/2050                                | 14 969           | 0,01              |
| 30 000 4.500% CNA Financial Corp 01/03/2026                             | 29 707           | 0,02              |
| 50 000 1.450% CNH Industrial Capital LLC 15/07/2026                     | 44 809           | 0,03              |
| 160 000 1.750% Coca-Cola Co 06/09/2024                                  | 155 259          | 0,10              |
| 100 000 2.900% Coca-Cola Co 25/05/2027                                  | 95 804           | 0,06              |
| 100 000 2.125% Coca-Cola Co 06/09/2029                                  | 89 789           | 0,06              |
| 70 000 1.650% Coca-Cola Co 01/06/2030                                   | 59 239           | 0,04              |
| 35 000 2.000% Coca-Cola Co 05/03/2031                                   | 29 940           | 0,02              |
| 50 000 1.375% Coca-Cola Co 15/03/2031                                   | 40 782           | 0,03              |
| 80 000 2.250% Coca-Cola Co 05/01/2032                                   | 69 568           | 0,04              |
| 50 000 2.750% Coca-Cola Femsa SAB de CV 22/01/2030                      | 44 528           | 0,03              |
| 25 000 3.100% Colgate-Palmolive Co 15/08/2027                           | 24 111           | 0,01              |
| 70 000 4.600% Colgate-Palmolive Co 01/03/2028                           | 71 788           | 0,04              |
| 65 000 3.700% Comcast Corp 15/04/2024                                   | 64 246           | 0,04              |
| 43 000 3.375% Comcast Corp 15/02/2025                                   | 42 173           | 0,03              |
| 192 000 3.375% Comcast Corp 15/08/2025                                  | 187 615          | 0,12              |
| 130 000 3.950% Comcast Corp 15/10/2025                                  | 128 526          | 0,08              |
| 50 000 5.250% Comcast Corp 07/11/2025                                   | 51 106           | 0,03              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 40 000 3.150% Comcast Corp 01/03/2026                                   | 38 800           | 0,02              |
| 30 000 2.350% Comcast Corp 15/01/2027                                   | 27 965           | 0,02              |
| 75 000 3.300% Comcast Corp 01/04/2027                                   | 72 101           | 0,04              |
| 50 000 5.350% Comcast Corp 15/11/2027                                   | 52 048           | 0,03              |
| 100 000 3.550% Comcast Corp 01/05/2028                                  | 96 144           | 0,06              |
| 100 000 4.150% Comcast Corp 15/10/2028                                  | 98 934           | 0,06              |
| 30 000 2.650% Comcast Corp 01/02/2030                                   | 26 717           | 0,02              |
| 160 000 3.400% Comcast Corp 01/04/2030                                  | 149 590          | 0,09              |
| 70 000 1.950% Comcast Corp 15/01/2031                                   | 58 196           | 0,04              |
| 20 000 5.500% Comcast Corp 15/11/2032                                   | 21 325           | 0,01              |
| 80 000 2.760% CommonSpirit Health 01/10/2024                            | 77 512           | 0,05              |
| 50 000 2.782% CommonSpirit Health 01/10/2030                            | 42 657           | 0,03              |
| 50 000 5.079% Commonwealth Bank of Australia/New York NY 10/01/2025     | 50 235           | 0,03              |
| 50 000 5.316% Commonwealth Bank of Australia/New York NY 13/03/2026     | 50 887           | 0,03              |
| 50 000 3.700% Commonwealth Edison Co 15/08/2028                         | 48 040           | 0,03              |
| 35 000 4.300% Conagra Brands Inc 01/05/2024                             | 34 667           | 0,02              |
| 50 000 4.600% Conagra Brands Inc 01/11/2025                             | 49 534           | 0,03              |
| 100 000 4.850% Conagra Brands Inc 01/11/2028                            | 99 716           | 0,06              |
| 25 000 8.250% Conagra Brands Inc 15/09/2030                             | 29 264           | 0,02              |
| 100 000 0.750% Connecticut Light and Power Co 01/12/2025                | 90 324           | 0,06              |
| 45 000 3.200% Connecticut Light and Power Co 15/03/2027                 | 43 150           | 0,03              |
| 25 000 2.050% Connecticut Light and Power Co 01/07/2031                 | 20 738           | 0,01              |
| 140 000 2.400% ConocoPhillips Co 07/03/2025                             | 134 376          | 0,08              |
| 40 000 6.950% ConocoPhillips Co 15/04/2029                              | 45 107           | 0,03              |
| 20 000 3.350% Consolidated Edison Co of New York Inc 01/04/2030         | 18 446           | 0,01              |
| 100 000 5.200% Consolidated Edison Co of New York Inc 01/03/2033        | 103 127          | 0,06              |
| 30 000 4.400% Constellation Brands Inc 15/11/2025                       | 29 607           | 0,02              |
| 45 000 4.350% Constellation Brands Inc 09/05/2027                       | 44 424           | 0,03              |
| 50 000 4.650% Constellation Brands Inc 15/11/2028                       | 49 887           | 0,03              |
| 35 000 3.150% Constellation Brands Inc 01/08/2029                       | 32 016           | 0,02              |
| 150 000 2.875% Constellation Brands Inc 01/05/2030                      | 131 491          | 0,08              |
| 50 000 2.250% Constellation Brands Inc 01/08/2031                       | 41 070           | 0,03              |
| 25 000 4.750% Constellation Brands Inc 09/05/2032                       | 24 705           | 0,02              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 10 000 3.250% Constellation Energy Generation LLC 01/06/2025            | 9 651            | 0,01              |
| 15 000 5.600% Constellation Energy Generation LLC 01/03/2028            | 15 427           | 0,01              |
| 25 000 4.650% Consumers Energy Co 01/03/2028                            | 25 227           | 0,02              |
| 60 000 3.800% Continental Resources Inc/OK 01/06/2024                   | 58 772           | 0,04              |
| 50 000 4.375% Continental Resources Inc/OK 15/01/2028                   | 47 175           | 0,03              |
| 25 000 4.375% Cooperatieve Rabobank UA 04/08/2025                       | 24 195           | 0,01              |
| 130 000 3.750% Cooperatieve Rabobank UA 21/07/2026                      | 122 894          | 0,08              |
| 50 000 3.875% Cooperatieve Rabobank UA/NY 22/08/2024                    | 49 238           | 0,03              |
| 50 000 1.375% Cooperatieve Rabobank UA/NY 10/01/2025                    | 46 984           | 0,03              |
| 100 000 5.000% Cooperatieve Rabobank UA/NY 13/01/2025                   | 100 155          | 0,06              |
| 100 000 3.500% Corebridge Financial Inc 04/04/2025                      | 96 180           | 0,06              |
| 20 000 2.250% Corporate Office Properties LP 15/03/2026                 | 17 787           | 0,01              |
| 20 000 2.000% Corporate Office Properties LP 15/01/2029                 | 15 497           | 0,01              |
| 30 000 2.750% Costco Wholesale Corp 18/05/2024                          | 29 364           | 0,02              |
| 70 000 3.000% Costco Wholesale Corp 18/05/2027                          | 67 436           | 0,04              |
| 200 000 1.375% Costco Wholesale Corp 20/06/2027                         | 179 490          | 0,11              |
| 50 000 1.600% Costco Wholesale Corp 20/04/2030                          | 42 436           | 0,03              |
| 60 000 3.625% Credit Suisse AG/New York NY 09/09/2024                   | 57 343           | 0,04              |
| 70 000 3.700% Credit Suisse AG/New York NY 21/02/2025                   | 66 445           | 0,04              |
| 100 000 2.950% Credit Suisse AG/New York NY 09/04/2025                  | 92 915           | 0,06              |
| 350 000 1.250% Credit Suisse AG/New York NY 07/08/2026                  | 296 324          | 0,18              |
| 60 000 3.750% Credit Suisse Group AG 26/03/2025                         | 55 281           | 0,03              |
| 20 000 7.125% Credit Suisse USA Inc 15/07/2032                          | 22 179           | 0,01              |
| 10 000 3.700% Crown Castle Inc 15/06/2026                               | 9 635            | 0,01              |
| 70 000 4.000% Crown Castle Inc 01/03/2027                               | 67 744           | 0,04              |
| 15 000 2.900% Crown Castle Inc 15/03/2027                               | 13 907           | 0,01              |
| 20 000 5.000% Crown Castle Inc 11/01/2028                               | 20 150           | 0,01              |
| 30 000 3.800% Crown Castle Inc 15/02/2028                               | 28 499           | 0,02              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 70 000 4.300% Crown Castle Inc 15/02/2029                               | 67 405           | 0,04              |
| 155 000 3.100% Crown Castle Inc 15/11/2029                              | 137 717          | 0,09              |
| 50 000 3.300% Crown Castle Inc 01/07/2030                               | 45 064           | 0,03              |
| 50 000 2.100% Crown Castle Inc 01/04/2031                               | 40 779           | 0,03              |
| 70 000 2.500% Crown Castle Inc 15/07/2031                               | 58 711           | 0,04              |
| 30 000 3.350% CSX Corp 01/11/2025                                       | 29 099           | 0,02              |
| 50 000 3.250% CSX Corp 01/06/2027                                       | 47 813           | 0,03              |
| 100 000 4.250% CSX Corp 15/03/2029                                      | 98 711           | 0,06              |
| 50 000 4.100% CSX Corp 15/11/2032                                       | 48 162           | 0,03              |
| 30 000 4.000% CubeSmart LP 15/11/2025                                   | 28 877           | 0,02              |
| 10 000 3.125% CubeSmart LP 01/09/2026                                   | 9 454            | 0,01              |
| 15 000 2.250% CubeSmart LP 15/12/2028                                   | 12 908           | 0,01              |
| 50 000 4.375% CubeSmart LP 15/02/2029                                   | 47 875           | 0,03              |
| 75 000 2.500% CubeSmart LP 15/02/2032                                   | 60 314           | 0,04              |
| 10 000 0.750% Cummins Inc 01/09/2025                                    | 9 138            | 0,01              |
| 30 000 1.500% Cummins Inc 01/09/2030                                    | 24 554           | 0,02              |
| 40 000 2.625% CVS Health Corp 15/08/2024                                | 38 841           | 0,02              |
| 88 000 4.100% CVS Health Corp 25/03/2025                                | 87 391           | 0,05              |
| 110 000 3.875% CVS Health Corp 20/07/2025                               | 108 027          | 0,07              |
| 50 000 2.875% CVS Health Corp 01/06/2026                                | 47 511           | 0,03              |
| 75 000 3.000% CVS Health Corp 15/08/2026                                | 71 562           | 0,04              |
| 50 000 3.625% CVS Health Corp 01/04/2027                                | 48 188           | 0,03              |
| 10 000 6.250% CVS Health Corp 01/06/2027                                | 10 558           | 0,01              |
| 50 000 1.300% CVS Health Corp 21/08/2027                                | 43 505           | 0,03              |
| 114 000 4.300% CVS Health Corp 25/03/2028                               | 111 970          | 0,07              |
| 50 000 3.250% CVS Health Corp 15/08/2029                                | 45 733           | 0,03              |
| 100 000 5.125% CVS Health Corp 21/02/2030                               | 101 263          | 0,06              |
| 140 000 3.750% CVS Health Corp 01/04/2030                               | 130 955          | 0,08              |
| 95 000 1.750% CVS Health Corp 21/08/2030                                | 77 223           | 0,05              |
| 100 000 5.250% CVS Health Corp 21/02/2033                               | 101 855          | 0,06              |
| 50 000 3.850% Darden Restaurants Inc 01/05/2027                         | 48 540           | 0,03              |
| 30 000 5.375% DCP Midstream Operating LP 15/07/2025                     | 29 905           | 0,02              |
| 50 000 5.125% DCP Midstream Operating LP 15/05/2029                     | 49 334           | 0,03              |
| 50 000 2.750% Deere & Co 15/04/2025                                     | 48 469           | 0,03              |
| 50 000 3.100% Deere & Co 15/04/2030                                     | 46 211           | 0,03              |
| 40 000 4.000% Dell International LLC / EMC Corp 15/07/2024              | 39 426           | 0,02              |
| 150 000 5.850% Dell International LLC / EMC Corp 15/07/2025             | 152 473          | 0,09              |
| 130 000 6.020% Dell International LLC / EMC Corp 15/06/2026             | 133 428          | 0,08              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 4.900% Dell International LLC / EMC Corp 01/10/2026             | 99 453           | 0,06              |
| 15 000 5.250% Dell International LLC / EMC Corp 01/02/2028              | 15 143           | 0,01              |
| 30 000 5.300% Dell International LLC / EMC Corp 01/10/2029              | 30 189           | 0,02              |
| 50 000 6.200% Dell International LLC / EMC Corp 15/07/2030              | 52 577           | 0,03              |
| 100 000 3.250% DENTSPLY SIRONA Inc 01/06/2030                           | 88 657           | 0,05              |
| 30 000 0.898% Deutsche Bank AG/New York NY 28/05/2024                   | 28 178           | 0,02              |
| 60 000 3.961% Deutsche Bank AG/New York NY 26/11/2025                   | 56 724           | 0,04              |
| 50 000 4.100% Deutsche Bank AG/New York NY 13/01/2026                   | 45 539           | 0,03              |
| 120 000 6.119% Deutsche Bank AG/New York NY 14/07/2026                  | 116 447          | 0,07              |
| 160 000 2.129% Deutsche Bank AG/New York NY 24/11/2026                  | 137 678          | 0,09              |
| 120 000 2.311% Deutsche Bank AG/New York NY 16/11/2027                  | 101 548          | 0,06              |
| 175 000 2.552% Deutsche Bank AG/New York NY 07/01/2028                  | 149 068          | 0,09              |
| 50 000 6.720% Deutsche Bank AG/New York NY 18/01/2029                   | 49 784           | 0,03              |
| 80 000 3.547% Deutsche Bank AG/New York NY 18/09/2031                   | 65 623           | 0,04              |
| 50 000 3.729% Deutsche Bank AG/New York NY 14/01/2032                   | 37 349           | 0,02              |
| 60 000 8.750% Deutsche Telekom International Finance BV 15/06/2030      | 73 321           | 0,05              |
| 70 000 9.250% Deutsche Telekom International Finance BV 01/06/2032      | 91 050           | 0,06              |
| 90 000 5.250% Devon Energy Corp 15/09/2024                              | 90 181           | 0,06              |
| 30 000 2.200% DH Europe Finance II Sarl 15/11/2024                      | 28 802           | 0,02              |
| 30 000 2.600% DH Europe Finance II Sarl 15/11/2029                      | 26 840           | 0,02              |
| 30 000 2.125% Diageo Capital PLC 24/10/2024                             | 28 811           | 0,02              |
| 150 000 5.200% Diageo Capital PLC 24/10/2025                            | 152 064          | 0,09              |
| 10 000 3.875% Diageo Capital PLC 18/05/2028                             | 9 775            | 0,01              |
| 50 000 2.375% Diageo Capital PLC 24/10/2029                             | 44 040           | 0,03              |
| 30 000 2.000% Diageo Capital PLC 29/04/2030                             | 25 562           | 0,02              |
| 60 000 2.125% Diageo Capital PLC 29/04/2032                             | 49 817           | 0,03              |
| 30 000 3.500% Diamondback Energy Inc 01/12/2029                         | 27 471           | 0,02              |
| 120 000 3.125% Diamondback Energy Inc 24/03/2031                        | 103 924          | 0,06              |



## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 10 000 3.150% Dick's Sporting Goods Inc 15/01/2032                      | 8 218            | 0,00              |
| 120 000 5.550% Digital Realty Trust LP 15/01/2028                       | 119 879          | 0,07              |
| 20 000 3.450% Discover Bank 27/07/2026                                  | 18 430           | 0,01              |
| 10 000 2.700% Discover Bank 06/02/2030                                  | 8 086            | 0,00              |
| 10 000 3.750% Discover Financial Services 04/03/2025                    | 9 485            | 0,01              |
| 225 000 4.100% Discover Financial Services 09/02/2027                   | 212 607          | 0,13              |
| 50 000 6.700% Discover Financial Services 29/11/2032                    | 51 605           | 0,03              |
| 100 000 3.900% Discovery Communications LLC 15/11/2024                  | 97 375           | 0,06              |
| 100 000 4.900% Discovery Communications LLC 11/03/2026                  | 99 349           | 0,06              |
| 100 000 3.950% Discovery Communications LLC 20/03/2028                  | 93 707           | 0,06              |
| 50 000 4.125% Discovery Communications LLC 15/05/2029                   | 46 494           | 0,03              |
| 55 000 3.875% Dollar General Corp 15/04/2027                            | 53 682           | 0,03              |
| 50 000 4.625% Dollar General Corp 01/11/2027                            | 49 913           | 0,03              |
| 50 000 4.125% Dollar General Corp 01/05/2028                            | 48 731           | 0,03              |
| 50 000 4.000% Dollar Tree Inc 15/05/2025                                | 49 039           | 0,03              |
| 100 000 4.200% Dollar Tree Inc 15/05/2028                               | 97 313           | 0,06              |
| 75 000 3.300% Dominion Energy Inc 15/03/2025                            | 72 383           | 0,04              |
| 50 000 4.250% Dominion Energy Inc 01/06/2028                            | 48 655           | 0,03              |
| 50 000 3.375% Dominion Energy Inc 01/04/2030                            | 45 317           | 0,03              |
| 25 000 2.250% Dominion Energy Inc 15/08/2031                            | 20 590           | 0,01              |
| 105 000 5.750% Dominion Energy Inc 01/10/2054                           | 98 734           | 0,06              |
| 55 000 3.150% Dover Corp 15/11/2025                                     | 53 170           | 0,03              |
| 50 000 7.375% Dow Chemical Co 01/11/2029                                | 57 074           | 0,04              |
| 20 000 2.100% Dow Chemical Co 15/11/2030                                | 16 720           | 0,01              |
| 50 000 2.600% DR Horton Inc 15/10/2025                                  | 46 789           | 0,03              |
| 45 000 1.300% DR Horton Inc 15/10/2026                                  | 39 736           | 0,02              |
| 115 000 1.900% DTE Electric Co 01/04/2028                               | 101 579          | 0,06              |
| 50 000 3.000% DTE Electric Co 01/03/2032                                | 43 953           | 0,03              |
| 80 000 2.529% DTE Energy Co 01/10/2024                                  | 76 985           | 0,05              |
| 50 000 4.220% DTE Energy Co 01/11/2024                                  | 49 482           | 0,03              |
| 48 000 3.400% DTE Energy Co 15/06/2029                                  | 43 950           | 0,03              |
| 65 000 2.550% Duke Energy Carolinas LLC 15/04/2031                      | 55 838           | 0,03              |
| 30 000 0.900% Duke Energy Corp 15/09/2025                               | 27 289           | 0,02              |
| 50 000 3.150% Duke Energy Corp 15/08/2027                               | 47 058           | 0,03              |
| 100 000 5.000% Duke Energy Corp 08/12/2027                              | 101 588          | 0,06              |
| 150 000 4.300% Duke Energy Corp 15/03/2028                              | 147 063          | 0,09              |
| 60 000 4.500% Duke Energy Corp 15/08/2032                               | 57 982           | 0,04              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 15 000 3.200% Duke Energy Florida LLC 15/01/2027                        | 14 315           | 0,01              |
| 50 000 3.650% Duke Energy Ohio Inc 01/02/2029                           | 47 518           | 0,03              |
| 35 000 5.250% Duke Energy Ohio Inc 01/04/2033                           | 36 066           | 0,02              |
| 100 000 3.450% Duke Energy Progress LLC 15/03/2029                      | 93 525           | 0,06              |
| 30 000 2.000% Duke Energy Progress LLC 15/08/2031                       | 24 546           | 0,02              |
| 150 000 5.250% Duke Energy Progress LLC 15/03/2033                      | 156 099          | 0,10              |
| 50 000 4.493% DuPont de Nemours Inc 15/11/2025                          | 49 960           | 0,03              |
| 70 000 4.725% DuPont de Nemours Inc 15/11/2028                          | 70 643           | 0,04              |
| 50 000 2.375% DXC Technology Co 15/09/2028                              | 42 422           | 0,03              |
| 115 000 2.500% Eagle Materials Inc 01/07/2031                           | 94 308           | 0,06              |
| 50 000 3.103% Eaton Corp 15/09/2027                                     | 47 354           | 0,03              |
| 60 000 4.000% Eaton Corp 02/11/2032                                     | 57 167           | 0,04              |
| 40 000 3.450% eBay Inc 01/08/2024                                       | 39 192           | 0,02              |
| 100 000 5.950% eBay Inc 22/11/2027                                      | 104 415          | 0,06              |
| 50 000 2.600% eBay Inc 10/05/2031                                       | 42 599           | 0,03              |
| 100 000 5.250% Ecolab Inc 15/01/2028                                    | 103 751          | 0,06              |
| 10 000 4.800% Ecolab Inc 24/03/2030                                     | 10 201           | 0,01              |
| 30 000 3.550% Edison International 15/11/2024                           | 29 135           | 0,02              |
| 50 000 5.750% Edison International 15/06/2027                           | 51 189           | 0,03              |
| 50 000 6.950% Edison International 15/11/2029                           | 54 203           | 0,03              |
| 80 000 4.300% Edwards Lifesciences Corp 15/06/2028                      | 79 674           | 0,05              |
| 20 000 3.500% Elevance Health Inc 15/08/2024                            | 19 594           | 0,01              |
| 50 000 3.350% Elevance Health Inc 01/12/2024                            | 48 832           | 0,03              |
| 110 000 2.375% Elevance Health Inc 15/01/2025                           | 105 349          | 0,07              |
| 55 000 4.101% Elevance Health Inc 01/03/2028                            | 53 914           | 0,03              |
| 65 000 2.250% Elevance Health Inc 15/05/2030                            | 55 797           | 0,03              |
| 100 000 2.550% Elevance Health Inc 15/03/2031                           | 85 968           | 0,05              |
| 25 000 4.100% Elevance Health Inc 15/05/2032                            | 23 903           | 0,01              |
| 50 000 5.500% Elevance Health Inc 15/10/2032                            | 52 526           | 0,03              |
| 25 000 4.750% Elevance Health Inc 15/02/2033                            | 25 130           | 0,02              |
| 100 000 2.750% Eli Lilly & Co 01/06/2025                                | 96 792           | 0,06              |
| 50 000 5.000% Eli Lilly & Co 27/02/2026                                 | 50 430           | 0,03              |
| 70 000 3.100% Eli Lilly & Co 15/05/2027                                 | 67 306           | 0,04              |
| 25 000 4.700% Eli Lilly & Co 27/02/2033                                 | 25 620           | 0,02              |
| 20 000 0.833% Emera US Finance LP 15/06/2024                            | 18 886           | 0,01              |
| 150 000 3.550% Emera US Finance LP 15/06/2026                           | 143 059          | 0,09              |
| 10 000 3.150% Emerson Electric Co 01/06/2025                            | 9 703            | 0,01              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 0.875% Emerson Electric Co 15/10/2026                            | 44 615           | 0,03              | 75 000 7.500% EQT Corp 01/02/2030                                       | 78 754           | 0,05              |
| 50 000 1.950% Emerson Electric Co 15/10/2030                            | 42 068           | 0,03              | 15 000 2.600% Equifax Inc 01/12/2024                                    | 14 330           | 0,01              |
| 30 000 2.143% Emory University 01/09/2030                               | 25 609           | 0,02              | 50 000 2.600% Equifax Inc 15/12/2025                                    | 46 632           | 0,03              |
| 50 000 3.500% Enbridge Inc 10/06/2024                                   | 48 945           | 0,03              | 25 000 5.100% Equifax Inc 15/12/2027                                    | 25 137           | 0,02              |
| 70 000 3.700% Enbridge Inc 15/07/2027                                   | 66 645           | 0,04              | 50 000 2.350% Equifax Inc 15/09/2031                                    | 40 240           | 0,02              |
| 30 000 5.700% Enbridge Inc 08/03/2033                                   | 31 233           | 0,02              | 145 000 2.625% Equinix Inc 18/11/2024                                   | 139 678          | 0,09              |
| 70 000 4.000% Enel Americas SA 25/10/2026                               | 67 379           | 0,04              | 20 000 1.450% Equinix Inc 15/05/2026                                    | 18 017           | 0,01              |
| 10 000 3.900% Energy Transfer LP 15/05/2024                             | 9 796            | 0,01              | 50 000 2.900% Equinix Inc 18/11/2026                                    | 46 500           | 0,03              |
| 50 000 4.050% Energy Transfer LP 15/03/2025                             | 49 051           | 0,03              | 20 000 3.200% Equinix Inc 18/11/2029                                    | 17 859           | 0,01              |
| 50 000 2.900% Energy Transfer LP 15/05/2025                             | 47 658           | 0,03              | 50 000 2.150% Equinix Inc 15/07/2030                                    | 40 850           | 0,03              |
| 25 000 4.750% Energy Transfer LP 15/01/2026                             | 24 711           | 0,02              | 55 000 2.500% Equinix Inc 15/05/2031                                    | 45 307           | 0,03              |
| 150 000 4.400% Energy Transfer LP 15/03/2027                            | 145 860          | 0,09              | 25 000 3.900% Equinix Inc 15/04/2032                                    | 22 710           | 0,01              |
| 90 000 4.200% Energy Transfer LP 15/04/2027                             | 86 542           | 0,05              | 100 000 5.594% Equitable Holdings Inc 11/01/2033                        | 98 096           | 0,06              |
| 50 000 4.000% Energy Transfer LP 01/10/2027                             | 47 674           | 0,03              | 5 000 3.500% ERP Operating LP 01/03/2028                                | 4 696            | 0,00              |
| 150 000 5.550% Energy Transfer LP 15/02/2028                            | 152 311          | 0,09              | 10 000 3.000% ERP Operating LP 01/07/2029                               | 8 901            | 0,01              |
| 50 000 5.250% Energy Transfer LP 15/04/2029                             | 49 874           | 0,03              | 90 000 2.500% ERP Operating LP 15/02/2030                               | 77 304           | 0,05              |
| 60 000 4.150% Energy Transfer LP 15/09/2029                             | 56 282           | 0,03              | 25 000 2.950% Essential Properties LP 15/07/2031                        | 18 453           | 0,01              |
| 60 000 3.750% Energy Transfer LP 15/05/2030                             | 55 357           | 0,03              | 20 000 2.704% Essential Utilities Inc 15/04/2030                        | 17 293           | 0,01              |
| 25 000 7.300% Eni USA Inc 15/11/2027                                    | 27 451           | 0,02              | 50 000 2.400% Essential Utilities Inc 01/05/2031                        | 41 516           | 0,03              |
| 30 000 4.950% Enstar Group Ltd 01/06/2029                               | 28 065           | 0,02              | 50 000 3.375% Essex Portfolio LP 15/04/2026                             | 47 723           | 0,03              |
| 80 000 3.100% Enstar Group Ltd 01/09/2031                               | 61 864           | 0,04              | 40 000 1.700% Essex Portfolio LP 01/03/2028                             | 34 387           | 0,02              |
| 80 000 3.500% Entergy Arkansas LLC 01/04/2026                           | 77 950           | 0,05              | 40 000 4.000% Essex Portfolio LP 01/03/2029                             | 37 665           | 0,02              |
| 70 000 4.000% Entergy Arkansas LLC 01/06/2028                           | 67 850           | 0,04              | 130 000 2.650% Essex Portfolio LP 15/03/2032                            | 105 880          | 0,07              |
| 50 000 2.950% Entergy Corp 01/09/2026                                   | 46 961           | 0,03              | 35 000 2.600% Estee Lauder Cos Inc 15/04/2030                           | 31 341           | 0,02              |
| 20 000 1.900% Entergy Corp 15/06/2028                                   | 17 416           | 0,01              | 25 000 1.950% Estee Lauder Cos Inc 15/03/2031                           | 21 014           | 0,01              |
| 30 000 2.800% Entergy Corp 15/06/2030                                   | 25 979           | 0,02              | 20 000 2.450% Evergy Inc 15/09/2024                                     | 19 196           | 0,01              |
| 200 000 2.350% Entergy Louisiana LLC 15/06/2032                         | 164 550          | 0,10              | 50 000 2.900% Evergy Inc 15/09/2029                                     | 44 824           | 0,03              |
| 11 000 3.750% Enterprise Products Operating LLC 15/02/2025              | 10 824           | 0,01              | 15 000 2.900% Eversource Energy 01/10/2024                              | 14 490           | 0,01              |
| 90 000 3.700% Enterprise Products Operating LLC 15/02/2026              | 87 875           | 0,05              | 25 000 1.400% Eversource Energy 15/08/2026                              | 22 396           | 0,01              |
| 50 000 3.950% Enterprise Products Operating LLC 15/02/2027              | 48 878           | 0,03              | 150 000 2.900% Eversource Energy 01/03/2027                             | 140 008          | 0,09              |
| 200 000 4.150% Enterprise Products Operating LLC 16/10/2028             | 194 320          | 0,12              | 50 000 4.600% Eversource Energy 01/07/2027                              | 50 057           | 0,03              |
| 10 000 3.125% Enterprise Products Operating LLC 31/07/2029              | 9 153            | 0,01              | 20 000 3.375% Eversource Energy 01/03/2032                              | 17 954           | 0,01              |
| 25 000 5.350% Enterprise Products Operating LLC 31/01/2033              | 25 990           | 0,02              | 50 000 3.950% Exelon Corp 15/06/2025                                    | 48 944           | 0,03              |
| 100 000 4.150% EOG Resources Inc 15/01/2026                             | 99 222           | 0,06              | 105 000 3.400% Exelon Corp 15/04/2026                                   | 100 974          | 0,06              |
| 100 000 4.500% EPR Properties 01/06/2027                                | 86 402           | 0,05              | 50 000 4.050% Exelon Corp 15/04/2030                                    | 47 672           | 0,03              |
| 40 000 7.875% EQT Corp 01/02/2025                                       | 40 245           | 0,02              | 100 000 5.300% Exelon Corp 15/03/2033                                   | 101 817          | 0,06              |
| 50 000 5.700% EQT Corp 01/04/2028                                       | 50 118           | 0,03              | 100 000 4.625% Expedia Group Inc 01/08/2027                             | 98 346           | 0,06              |
|   |                  |                   | 60 000 3.250% Expedia Group Inc 15/02/2030                              | 52 056           | 0,03              |
|   |                  |                   | 5 000 3.900% Extra Space Storage LP 01/04/2029                          | 4 614            | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 2.350% Extra Space Storage LP 15/03/2032                        | 78 570           | 0,05              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>         |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>   |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                                 |                  |                   |
| 125 000 2.019% Exxon Mobil Corp 16/08/2024                              | 120 909          | 0,07              | 100 000 5.600% Fiserv Inc 02/03/2033                                      | 103 780          | 0,06              |
| 140 000 2.992% Exxon Mobil Corp 19/03/2025                              | 136 241          | 0,08              | 15 000 4.750% Flex Ltd 15/06/2025   | 14 753           | 0,01              |
| 70 000 3.043% Exxon Mobil Corp 01/03/2026                               | 67 958           | 0,04              | 70 000 3.750% Flex Ltd 01/02/2026   | 67 227           | 0,04              |
| 45 000 2.275% Exxon Mobil Corp 16/08/2026                               | 42 259           | 0,03              | 50 000 2.850% Florida Power & Light Co 01/04/2025                         | 48 507           | 0,03              |
| 50 000 2.440% Exxon Mobil Corp 16/08/2029                               | 45 787           | 0,03              | 115 000 5.050% Florida Power & Light Co 01/04/2028                        | 118 943          | 0,07              |
| 55 000 3.482% Exxon Mobil Corp 19/03/2030                               | 52 550           | 0,03              | 100 000 3.500% Flowserve Corp 01/10/2030                                  | 86 775           | 0,05              |
| 35 000 2.610% Exxon Mobil Corp 15/10/2030                               | 31 436           | 0,02              | 65 000 3.450% FMC Corp 01/10/2029   | 59 069           | 0,04              |
| 50 000 7.400% F&G Annuities & Life Inc 13/01/2028                       | 50 345           | 0,03              | 10 000 1.000% Fortinet Inc 15/03/2026                                     | 8 989            | 0,01              |
| 20 000 2.900% FactSet Research Systems Inc 01/03/2027                   | 18 596           | 0,01              | 5 000 3.055% Fortis Inc/Canada 04/10/2026                                 | 4 689            | 0,00              |
| 25 000 4.625% Fairfax Financial Holdings Ltd 29/04/2030                 | 23 569           | 0,01              | 100 000 3.150% Fortive Corp 15/06/2026                                    | 95 349           | 0,06              |
| 120 000 3.375% Fairfax Financial Holdings Ltd 03/03/2031                | 100 703          | 0,06              | 25 000 4.000% Fortune Brands Innovations Inc 25/03/2032                   | 22 487           | 0,01              |
| 50 000 1.250% Federal Realty Investment Trust 15/02/2026                | 45 495           | 0,03              | 170 000 4.709% Fox Corp 25/01/2029  | 168 492          | 0,10              |
| 50 000 3.250% Federal Realty Investment Trust 15/07/2027                | 46 204           | 0,03              | 70 000 5.000% Freeport-McMoRan Inc 01/09/2027                             | 68 916           | 0,04              |
| 30 000 3.200% Federal Realty Investment Trust 15/06/2029                | 26 677           | 0,02              | 20 000 4.125% Freeport-McMoRan Inc 01/03/2028                             | 18 825           | 0,01              |
| 225 000 3.250% FedEx Corp 01/04/2026                                    | 218 416          | 0,14              | 50 000 4.625% Freeport-McMoRan Inc 01/08/2030                             | 47 443           | 0,03              |
| 50 000 2.400% FedEx Corp 15/05/2031                                     | 42 577           | 0,03              | 30 000 4.625% FS KKR Capital Corp 15/07/2024                              | 28 969           | 0,02              |
| 40 000 5.500% Fibria Overseas Finance Ltd 17/01/2027                    | 40 174           | 0,02              | 50 000 3.400% FS KKR Capital Corp 15/01/2026                              | 45 041           | 0,03              |
| 40 000 3.400% Fidelity National Financial Inc 15/06/2030                | 35 050           | 0,02              | 65 000 3.125% FS KKR Capital Corp 12/10/2028                              | 53 050           | 0,03              |
| 200 000 1.650% Fidelity National Information Services Inc 01/03/2028    | 170 956          | 0,11              | 60 000 3.250% GATX Corp 15/09/2026  | 56 539           | 0,03              |
| 50 000 5.100% Fidelity National Information Services Inc 15/07/2032     | 48 745           | 0,03              | 30 000 4.000% GATX Corp 30/06/2030  | 27 593           | 0,02              |
| 15 000 1.707% Fifth Third Bancorp 01/11/2027                            | 12 683           | 0,01              | 30 000 3.500% GATX Corp 01/06/2032  | 26 374           | 0,02              |
| 170 000 6.361% Fifth Third Bancorp 27/10/2028                           | 171 054          | 0,11              | 30 000 4.550% GE Capital Funding LLC 15/05/2032                           | 29 425           | 0,02              |
| 50 000 4.772% Fifth Third Bancorp 28/07/2030                            | 46 143           | 0,03              | 40 000 3.373% GE Capital International Funding Co Unlimited Co 15/11/2025 | 38 747           | 0,02              |
| 100 000 5.852% Fifth Third Bank NA 27/10/2025                           | 98 797           | 0,06              | 100 000 5.600% GE HealthCare Technologies Inc 15/11/2025                  | 101 241          | 0,06              |
| 20 000 3.850% Fifth Third Bank NA 15/03/2026                            | 18 268           | 0,01              | 50 000 5.650% GE HealthCare Technologies Inc 15/11/2027                   | 51 697           | 0,03              |
| 20 000 4.000% First American Financial Corp 15/05/2030                  | 18 023           | 0,01              | 70 000 5.905% GE HealthCare Technologies Inc 22/11/2032                   | 74 420           | 0,05              |
| 20 000 2.400% First American Financial Corp 15/08/2031                  | 15 482           | 0,01              | 90 000 3.250% General Dynamics Corp 01/04/2025                            | 87 616           | 0,05              |
| 20 000 5.750% First Horizon Bank 01/05/2030                             | 18 780           | 0,01              | 30 000 3.500% General Dynamics Corp 15/05/2025                            | 29 414           | 0,02              |
| 75 000 2.750% Fiserv Inc 01/07/2024                                     | 72 790           | 0,05              | 40 000 1.150% General Dynamics Corp 01/06/2026                            | 36 318           | 0,02              |
| 20 000 3.850% Fiserv Inc 01/06/2025                                     | 19 583           | 0,01              | 50 000 3.500% General Dynamics Corp 01/04/2027                            | 48 402           | 0,03              |
| 50 000 2.250% Fiserv Inc 01/06/2027                                     | 45 276           | 0,03              | 30 000 3.750% General Dynamics Corp 15/05/2028                            | 29 321           | 0,02              |
| 55 000 5.450% Fiserv Inc 02/03/2028                                     | 56 180           | 0,03              | 20 000 3.625% General Dynamics Corp 01/04/2030                            | 19 156           | 0,01              |
| 50 000 4.200% Fiserv Inc 01/10/2028                                     | 48 442           | 0,03              |   |                  |                   |
| 200 000 3.500% Fiserv Inc 01/07/2029                                    | 185 624          | 0,12              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 30 000 4.000% General Mills Inc 17/04/2025                              | 29 604           | 0,02              | 45 000 4.700% Georgia Power Co 15/05/2032                               | 44 612           | 0,03              |
| 140 000 5.241% General Mills Inc 18/11/2025                             | 140 364          | 0,09              | 40 000 7.750% Georgia-Pacific LLC 15/11/2029                            | 46 971           | 0,03              |
| 50 000 3.200% General Mills Inc 10/02/2027                              | 48 082           | 0,03              | 50 000 3.700% Gilead Sciences Inc 01/04/2024                            | 49 412           | 0,03              |
| 10 000 4.200% General Mills Inc 17/04/2028                              | 9 897            | 0,01              | 50 000 3.500% Gilead Sciences Inc 01/02/2025                            | 49 040           | 0,03              |
| 10 000 2.875% General Mills Inc 15/04/2030                              | 8 976            | 0,01              | 135 000 3.650% Gilead Sciences Inc 01/03/2026                           | 132 204          | 0,08              |
| 70 000 4.950% General Mills Inc 29/03/2033                              | 71 109           | 0,04              | 150 000 2.950% Gilead Sciences Inc 01/03/2027                           | 142 806          | 0,09              |
| 55 000 6.125% General Motors Co 01/10/2025                              | 55 961           | 0,03              | 10 000 1.200% Gilead Sciences Inc 01/10/2027                            | 8 739            | 0,01              |
| 30 000 4.200% General Motors Co 01/10/2027                              | 28 765           | 0,02              | 50 000 1.650% Gilead Sciences Inc 01/10/2030                            | 41 186           | 0,03              |
| 30 000 6.800% General Motors Co 01/10/2027                              | 31 727           | 0,02              | 20 000 3.625% GlaxoSmithKline Capital Inc 15/05/2025                    | 19 759           | 0,01              |
| 15 000 5.000% General Motors Co 01/10/2028                              | 14 777           | 0,01              | 50 000 3.875% GlaxoSmithKline Capital Inc 15/05/2028                    | 49 082           | 0,03              |
| 25 000 5.400% General Motors Co 15/10/2029                              | 24 797           | 0,02              | 50 000 3.000% GlaxoSmithKline Capital PLC 01/06/2024                    | 49 004           | 0,03              |
| 25 000 3.950% General Motors Financial Co Inc 13/04/2024                | 24 577           | 0,02              | 75 000 3.375% GlaxoSmithKline Capital PLC 01/06/2029                    | 71 250           | 0,04              |
| 20 000 4.350% General Motors Financial Co Inc 09/04/2025                | 19 593           | 0,01              | 80 000 2.650% Global Payments Inc 15/02/2025                            | 76 137           | 0,05              |
| 50 000 6.050% General Motors Financial Co Inc 10/10/2025                | 50 832           | 0,03              | 50 000 1.200% Global Payments Inc 01/03/2026                            | 44 519           | 0,03              |
| 120 000 1.250% General Motors Financial Co Inc 08/01/2026               | 108 052          | 0,07              | 20 000 4.800% Global Payments Inc 01/04/2026                            | 19 606           | 0,01              |
| 70 000 5.250% General Motors Financial Co Inc 01/03/2026                | 70 009           | 0,04              | 75 000 2.150% Global Payments Inc 15/01/2027                            | 66 447           | 0,04              |
| 300 000 1.500% General Motors Financial Co Inc 10/06/2026               | 267 180          | 0,17              | 50 000 4.950% Global Payments Inc 15/08/2027                            | 49 353           | 0,03              |
| 50 000 4.000% General Motors Financial Co Inc 06/10/2026                | 47 813           | 0,03              | 30 000 4.450% Global Payments Inc 01/06/2028                            | 28 497           | 0,02              |
| 50 000 4.350% General Motors Financial Co Inc 17/01/2027                | 48 487           | 0,03              | 25 000 2.900% Global Payments Inc 15/11/2031                            | 20 490           | 0,01              |
| 75 000 2.350% General Motors Financial Co Inc 26/02/2027                | 67 141           | 0,04              | 50 000 5.400% Global Payments Inc 15/08/2032                            | 48 965           | 0,03              |
| 50 000 5.000% General Motors Financial Co Inc 09/04/2027                | 49 449           | 0,03              | 10 000 4.550% Globe Life Inc 15/09/2028                                 | 9 934            | 0,01              |
| 100 000 2.700% General Motors Financial Co Inc 20/08/2027               | 89 520           | 0,06              | 75 000 2.150% Globe Life Inc 15/08/2030                                 | 60 747           | 0,04              |
| 40 000 6.000% General Motors Financial Co Inc 09/01/2028                | 40 933           | 0,03              | 120 000 5.375% GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 15/04/2026         | 116 665          | 0,07              |
| 45 000 2.400% General Motors Financial Co Inc 15/10/2028                | 38 552           | 0,02              | 90 000 5.750% GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 01/06/2028          | 87 780           | 0,05              |
| 25 000 4.300% General Motors Financial Co Inc 06/04/2029                | 23 293           | 0,01              | 20 000 3.250% GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 15/01/2032          | 16 329           | 0,01              |
| 115 000 3.600% General Motors Financial Co Inc 21/06/2030               | 100 616          | 0,06              | 50 000 2.875% Goldman Sachs BDC Inc 15/01/2026                          | 45 394           | 0,03              |
| 100 000 2.700% General Motors Financial Co Inc 10/06/2031               | 80 185           | 0,05              | 65 000 3.850% Goldman Sachs Group Inc 08/07/2024                        | 63 894           | 0,04              |
| 15 000 3.375% Genpact Luxembourg Sarl 01/12/2024                        | 14 464           | 0,01              | 40 000 3.500% Goldman Sachs Group Inc 23/01/2025                        | 38 924           | 0,02              |
| 25 000 1.750% Genuine Parts Co 01/02/2025                               | 23 637           | 0,01              | 75 000 3.500% Goldman Sachs Group Inc 01/04/2025                        | 72 829           | 0,05              |
| 50 000 2.750% Genuine Parts Co 01/02/2032                               | 41 546           | 0,03              | 130 000 3.750% Goldman Sachs Group Inc 22/05/2025                       | 126 249          | 0,08              |
| 50 000 2.200% Georgia Power Co 15/09/2024                               | 47 997           | 0,03              | 243 000 3.272% Goldman Sachs Group Inc 29/09/2025                       | 235 637          | 0,15              |
| 5 000 3.250% Georgia Power Co 30/03/2027                                | 4 763            | 0,00              | 60 000 4.250% Goldman Sachs Group Inc 21/10/2025                        | 58 286           | 0,04              |
|   |                  |                   | 20 000 3.750% Goldman Sachs Group Inc 25/02/2026                        | 19 454           | 0,01              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 190 000 3.500% Goldman Sachs Group Inc 16/11/2026                       | 181 477          | 0,11              | 30 000 2.800% Hartford Financial Services Group Inc 19/08/2029          | 26 387           | 0,02              |
| 50 000 1.093% Goldman Sachs Group Inc 09/12/2026                        | 44 750           | 0,03              | 30 000 3.550% Hasbro Inc 19/11/2026                                     | 28 187           | 0,02              |
| 70 000 3.850% Goldman Sachs Group Inc 26/01/2027                        | 67 584           | 0,04              | 5 000 3.500% Hasbro Inc 15/09/2027                                      | 4 709            | 0,00              |
| 50 000 1.431% Goldman Sachs Group Inc 09/03/2027                        | 44 693           | 0,03              | 70 000 3.900% Hasbro Inc 19/11/2029                                     | 63 748           | 0,04              |
| 50 000 1.542% Goldman Sachs Group Inc 10/09/2027                        | 44 011           | 0,03              | 20 000 5.375% HCA Inc 01/02/2025  | 20 007           | 0,01              |
| 75 000 1.948% Goldman Sachs Group Inc 21/10/2027                        | 66 977           | 0,04              | 200 000 5.250% HCA Inc 15/04/2025                                       | 200 594          | 0,12              |
| 180 000 2.640% Goldman Sachs Group Inc 24/02/2028                       | 164 340          | 0,10              | 130 000 5.875% HCA Inc 15/02/2026                                       | 131 897          | 0,08              |
| 260 000 3.615% Goldman Sachs Group Inc 15/03/2028                       | 246 194          | 0,15              | 30 000 5.250% HCA Inc 15/06/2026  | 30 035           | 0,02              |
| 70 000 3.691% Goldman Sachs Group Inc 05/06/2028                        | 66 424           | 0,04              | 200 000 5.375% HCA Inc 01/09/2026                                       | 200 680          | 0,12              |
| 340 000 4.482% Goldman Sachs Group Inc 23/08/2028                       | 332 629          | 0,21              | 30 000 4.500% HCA Inc 15/02/2027  | 29 321           | 0,02              |
| 90 000 3.814% Goldman Sachs Group Inc 23/04/2029                        | 84 660           | 0,05              | 30 000 5.625% HCA Inc 01/09/2028  | 30 356           | 0,02              |
| 145 000 4.223% Goldman Sachs Group Inc 01/05/2029                       | 138 379          | 0,09              | 100 000 5.875% HCA Inc 01/02/2029                                       | 102 143          | 0,06              |
| 15 000 2.600% Goldman Sachs Group Inc 07/02/2030                        | 12 882           | 0,01              | 105 000 2.375% HCA Inc 15/07/2031                                       | 84 659           | 0,05              |
| 110 000 3.800% Goldman Sachs Group Inc 15/03/2030                       | 102 456          | 0,06              | 100 000 3.750% Healthcare Realty Holdings LP 01/07/2027                 | 93 789           | 0,06              |
| 347 000 1.992% Goldman Sachs Group Inc 27/01/2032                       | 276 764          | 0,17              | 20 000 3.250% Healthpeak Properties Interim Inc 15/07/2026              | 19 009           | 0,01              |
| 105 000 2.615% Goldman Sachs Group Inc 22/04/2032                       | 87 462           | 0,05              | 20 000 2.875% Healthpeak Properties Interim Inc 15/01/2031              | 17 214           | 0,01              |
| 100 000 2.383% Goldman Sachs Group Inc 21/07/2032                       | 81 350           | 0,05              | 50 000 5.250% Healthpeak Properties Interim Inc 15/12/2032              | 50 123           | 0,03              |
| 80 000 2.650% Goldman Sachs Group Inc 21/10/2032                        | 65 974           | 0,04              | 50 000 2.900% Helmerich & Payne Inc 29/09/2031                          | 41 406           | 0,03              |
| 130 000 3.102% Goldman Sachs Group Inc 24/02/2033                       | 111 418          | 0,07              | 50 000 3.375% Hercules Capital Inc 20/01/2027                           | 42 852           | 0,03              |
| 20 000 2.500% Golub Capital BDC Inc 24/08/2026                          | 17 213           | 0,01              | 40 000 0.900% Hershey Co 01/06/2025                                     | 37 074           | 0,02              |
| 100 000 2.050% Golub Capital BDC Inc 15/02/2027                         | 81 846           | 0,05              | 10 000 2.300% Hershey Co 15/08/2026                                     | 9 500            | 0,01              |
| 50 000 3.125% GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC 24/03/2025         | 48 315           | 0,03              | 54 000 0.000% Hess Corp 01/04/2027                                      | 52 673           | 0,03              |
| 50 000 3.375% GSK Consumer Healthcare Capital US LLC 24/03/2029         | 46 078           | 0,03              | 100 000 7.300% Hess Corp 15/08/2031                                     | 111 315          | 0,07              |
| 150 000 3.625% GSK Consumer Healthcare Capital US LLC 24/03/2032        | 136 195          | 0,08              | 100 000 1.450% Hewlett Packard Enterprise Co 01/04/2024                 | 96 196           | 0,06              |
| 50 000 1.650% GXO Logistics Inc 15/07/2026                              | 43 935           | 0,03              | 30 000 4.900% Hewlett Packard Enterprise Co 15/10/2025                  | 29 922           | 0,02              |
| 50 000 2.650% GXO Logistics Inc 15/07/2031                              | 38 966           | 0,02              | 80 000 4.500% HF Sinclair Corp 01/10/2030                               | 72 486           | 0,04              |
| 50 000 3.500% Harley-Davidson Inc 28/07/2025                            | 47 730           | 0,03              | 60 000 4.200% Highwoods Realty LP 15/04/2029                            | 50 977           | 0,03              |
|   |                  |                   | 170 000 3.050% Highwoods Realty LP 15/02/2030                           | 134 149          | 0,08              |
|   |                  |                   | 75 000 2.700% Home Depot Inc 15/04/2025                                 | 72 688           | 0,05              |
|   |                  |                   | 50 000 3.350% Home Depot Inc 15/09/2025                                 | 48 963           | 0,03              |
|   |                  |                   | 50 000 4.000% Home Depot Inc 15/09/2025                                 | 49 727           | 0,03              |
|   |                  |                   | 70 000 3.000% Home Depot Inc 01/04/2026                                 | 67 903           | 0,04              |
|   |                  |                   | 100 000 2.875% Home Depot Inc 15/04/2027                                | 95 321           | 0,06              |
|   |                  |                   | 75 000 1.500% Home Depot Inc 15/09/2028                                 | 65 392           | 0,04              |
|   |                  |                   | 100 000 3.900% Home Depot Inc 06/12/2028                                | 98 498           | 0,06              |
|   |                  |                   | 30 000 2.950% Home Depot Inc 15/06/2029                                 | 27 744           | 0,02              |
|   |                  |                   | 35 000 2.700% Home Depot Inc 15/04/2030                                 | 31 626           | 0,02              |
|   |                  |                   | 50 000 1.375% Home Depot Inc 15/03/2031                                 | 40 030           | 0,02              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 40 000 1.875% Home Depot Inc 15/09/2031                                 | 33 094           | 0,02              | 110 000 4.762% HSBC Holdings PLC 29/03/2033                             | 100 300          | 0,06              |
| 20 000 3.250% Home Depot Inc 15/04/2032                                 | 18 257           | 0,01              | 100 000 8.113% HSBC Holdings PLC 03/11/2033                             | 111 672          | 0,07              |
| 15 000 4.500% Home Depot Inc 15/09/2032                                 | 15 098           | 0,01              | 300 000 5.625% HSBC USA Inc 17/03/2025                                  | 301 245          | 0,19              |
| 30 000 2.534% Honda Motor Co Ltd 10/03/2027                             | 28 136           | 0,02              | 10 000 3.350% Hubbell Inc 01/03/2026                                    | 9 666            | 0,01              |
| 100 000 2.967% Honda Motor Co Ltd 10/03/2032                            | 89 847           | 0,06              | 70 000 3.150% Hubbell Inc 15/08/2027                                    | 66 146           | 0,04              |
| 200 000 2.300% Honeywell International Inc 15/08/2024                   | 194 248          | 0,12              | 30 000 3.250% Hudson Pacific Properties LP 15/01/2030                   | 19 233           | 0,01              |
| 60 000 1.350% Honeywell International Inc 01/06/2025                    | 56 565           | 0,03              | 25 000 4.500% Humana Inc 01/04/2025                                     | 24 841           | 0,02              |
| 35 000 2.500% Honeywell International Inc 01/11/2026                    | 33 233           | 0,02              | 100 000 1.350% Humana Inc 03/02/2027                                    | 87 891           | 0,05              |
| 50 000 2.700% Honeywell International Inc 15/08/2029                    | 46 079           | 0,03              | 50 000 3.700% Humana Inc 23/03/2029                                     | 46 905           | 0,03              |
| 30 000 1.950% Honeywell International Inc 01/06/2030                    | 25 657           | 0,02              | 50 000 3.125% Humana Inc 15/08/2029                                     | 45 243           | 0,03              |
| 100 000 1.700% Hormel Foods Corp 03/06/2028                             | 88 177           | 0,05              | 100 000 4.875% Humana Inc 01/04/2030                                    | 100 606          | 0,06              |
| 70 000 4.000% Host Hotels & Resorts LP 15/06/2025                       | 67 276           | 0,04              | 30 000 2.625% Huntington Bancshares Inc/OH 06/08/2024                   | 28 072           | 0,02              |
| 6 000 4.500% Host Hotels & Resorts LP 01/02/2026                        | 5 799            | 0,00              | 130 000 2.550% Huntington Bancshares Inc/OH 04/02/2030                  | 102 930          | 0,06              |
| 50 000 2.900% Host Hotels & Resorts LP 15/12/2031                       | 39 039           | 0,02              | 35 000 5.023% Huntington Bancshares Inc/OH 17/05/2033                   | 31 998           | 0,02              |
| 140 000 2.200% HP Inc 17/06/2025  | 132 042          | 0,08              | 30 000 3.483% Huntington Ingalls Industries Inc 01/12/2027              | 28 023           | 0,02              |
| 80 000 3.400% HP Inc 17/06/2030   | 70 858           | 0,04              | 50 000 4.200% Huntington Ingalls Industries Inc 01/05/2030              | 46 934           | 0,03              |
| 50 000 2.650% HP Inc 17/06/2031   | 40 813           | 0,03              | 100 000 5.699% Huntington National Bank 18/11/2025                      | 96 778           | 0,06              |
| 125 000 4.200% HP Inc 15/04/2032  | 112 567          | 0,07              | 50 000 5.650% Huntington National Bank 10/01/2030                       | 48 113           | 0,03              |
| 50 000 0.976% HSBC Holdings PLC 24/05/2025                              | 47 075           | 0,03              | 20 000 1.800% Hyatt Hotels Corp 01/10/2024                              | 18 905           | 0,01              |
| 121 000 4.250% HSBC Holdings PLC 18/08/2025                             | 115 314          | 0,07              | 50 000 5.375% Hyatt Hotels Corp 23/04/2025                              | 49 732           | 0,03              |
| 50 000 2.633% HSBC Holdings PLC 07/11/2025                              | 47 273           | 0,03              | 25 000 4.850% Hyatt Hotels Corp 15/03/2026                              | 24 889           | 0,02              |
| 250 000 4.180% HSBC Holdings PLC 09/12/2025                             | 242 690          | 0,15              | 20 000 5.750% Hyatt Hotels Corp 23/04/2030                              | 20 300           | 0,01              |
| 150 000 1.645% HSBC Holdings PLC 18/04/2026                             | 137 058          | 0,08              | 15 000 3.000% IDEX Corp 01/05/2030                                      | 13 220           | 0,01              |
| 50 000 2.099% HSBC Holdings PLC 04/06/2026                              | 45 944           | 0,03              | 10 000 2.625% IDEX Corp 15/06/2031                                      | 8 457            | 0,01              |
| 150 000 4.292% HSBC Holdings PLC 12/09/2026                             | 143 535          | 0,09              | 75 000 2.650% Illinois Tool Works Inc 15/11/2026                        | 71 362           | 0,04              |
| 350 000 1.589% HSBC Holdings PLC 24/05/2027                             | 308 535          | 0,19              | 125 000 5.750% Illumina Inc 13/12/2027                                  | 128 059          | 0,08              |
| 100 000 2.251% HSBC Holdings PLC 22/11/2027                             | 88 555           | 0,05              | 60 000 3.550% ING Groep NV 09/04/2024                                   | 58 867           | 0,04              |
| 150 000 4.041% HSBC Holdings PLC 13/03/2028                             | 141 225          | 0,09              | 70 000 3.869% ING Groep NV 28/03/2026                                   | 67 712           | 0,04              |
| 150 000 5.210% HSBC Holdings PLC 11/08/2028                             | 148 752          | 0,09              | 55 000 3.950% ING Groep NV 29/03/2027                                   | 52 559           | 0,03              |
| 4 000 2.013% HSBC Holdings PLC 22/09/2028                               | 3 427            | 0,00              | 200 000 1.726% ING Groep NV 01/04/2027                                  | 178 036          | 0,11              |
| 190 000 4.583% HSBC Holdings PLC 19/06/2029                             | 180 720          | 0,11              | 20 000 4.550% ING Groep NV 02/10/2028                                   | 19 192           | 0,01              |
| 60 000 2.206% HSBC Holdings PLC 17/08/2029                              | 50 448           | 0,03              | 50 000 2.727% ING Groep NV 01/04/2032                                   | 41 150           | 0,03              |
| 50 000 4.950% HSBC Holdings PLC 31/03/2030                              | 49 046           | 0,03              | 20 000 2.900% Ingredion Inc 01/06/2030                                  | 17 570           | 0,01              |
| 90 000 3.973% HSBC Holdings PLC 22/05/2030                              | 81 337           | 0,05              | 20 000 2.875% Intel Corp 11/05/2024                                     | 19 664           | 0,01              |
| 90 000 2.848% HSBC Holdings PLC 04/06/2031                              | 75 624           | 0,05              | 99 000 3.400% Intel Corp 25/03/2025                                     | 97 295           | 0,06              |
| 50 000 2.357% HSBC Holdings PLC 18/08/2031                              | 40 340           | 0,02              | 60 000 3.700% Intel Corp 29/07/2025                                     | 59 142           | 0,04              |
| 150 000 2.804% HSBC Holdings PLC 24/05/2032                             | 122 577          | 0,08              | 40 000 4.875% Intel Corp 10/02/2026                                     | 40 521           | 0,03              |
| 290 000 2.871% HSBC Holdings PLC 22/11/2032                             | 236 219          | 0,15              | 30 000 3.150% Intel Corp 11/05/2027                                     | 28 736           | 0,02              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>               |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>         |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                                       |                  |                   |
| 50 000 3.750% Intel Corp 05/08/2027                                     | 48 855           | 0,03              | 10 000 0.950% Intuit Inc 15/07/2025   | 9 231            | 0,01              |
| 40 000 4.875% Intel Corp 10/02/2028                                     | 40 635           | 0,03              | 25 000 1.350% Intuit Inc 15/07/2027   | 22 223           | 0,01              |
| 150 000 1.600% Intel Corp 12/08/2028                                    | 130 944          | 0,08              | 40 000 3.750% Invesco Finance PLC 15/01/2026                                    | 38 425           | 0,02              |
| 50 000 4.000% Intel Corp 05/08/2029                                     | 48 676           | 0,03              | 10 000 2.300% Invitation Homes Operating Partnership LP 15/11/2028              | 8 367            | 0,01              |
| 200 000 5.125% Intel Corp 10/02/2030                                    | 203 606          | 0,13              | 15 000 4.150% Invitation Homes Operating Partnership LP 15/04/2032              | 13 437           | 0,01              |
| 40 000 3.900% Intel Corp 25/03/2030                                     | 38 124           | 0,02              | 10 000 3.700% IPALCO Enterprises Inc 01/09/2024                                 | 9 741            | 0,01              |
| 48 000 4.150% Intel Corp 05/08/2032                                     | 46 300           | 0,03              | 15 000 3.250% ITC Holdings Corp 30/06/2026                                      | 14 258           | 0,01              |
| 135 000 5.200% Intel Corp 10/02/2033                                    | 137 294          | 0,09              | 25 000 3.500% J M Smucker Co 15/03/2025   | 24 400           | 0,02              |
| 50 000 3.100% Intercontinental Exchange Inc 15/09/2027                  | 47 261           | 0,03              | 30 000 3.375% J M Smucker Co 15/12/2027   | 28 535           | 0,02              |
| 100 000 4.000% Intercontinental Exchange Inc 15/09/2027                 | 98 879           | 0,06              | 50 000 1.700% Jabil Inc 15/04/2026  | 44 874           | 0,03              |
| 50 000 3.750% Intercontinental Exchange Inc 21/09/2028                  | 48 069           | 0,03              | 55 000 4.250% Jabil Inc 15/05/2027  | 53 054           | 0,03              |
| 100 000 4.350% Intercontinental Exchange Inc 15/06/2029                 | 98 834           | 0,06              | 25 000 3.600% Jabil Inc 15/01/2030  | 22 590           | 0,01              |
| 10 000 2.100% Intercontinental Exchange Inc 15/06/2030                  | 8 467            | 0,01              | 50 000 3.125% Jackson Financial Inc 23/11/2031                                  | 41 096           | 0,03              |
| 50 000 1.850% Intercontinental Exchange Inc 15/09/2032                  | 39 407           | 0,02              | 100 000 5.900% Jacobs Engineering Group Inc 01/03/2033                          | 100 171          | 0,06              |
| 50 000 3.000% International Business Machines Corp 15/05/2024           | 49 078           | 0,03              | 85 000 2.500% JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc 15/01/2027 | 74 896           | 0,05              |
| 100 000 4.000% International Business Machines Corp 27/07/2025          | 98 869           | 0,06              | 50 000 3.000% JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc 15/05/2032 | 39 292           | 0,02              |
| 50 000 7.000% International Business Machines Corp 30/10/2025           | 52 941           | 0,03              | 30 000 3.875% JD.com Inc 29/04/2026   | 29 120           | 0,02              |
| 90 000 3.300% International Business Machines Corp 15/05/2026           | 86 774           | 0,05              | 100 000 4.850% Jefferies Financial Group Inc 15/01/2027                         | 97 922           | 0,06              |
| 25 000 3.300% International Business Machines Corp 27/01/2027           | 23 954           | 0,01              | 100 000 4.150% Jefferies Financial Group Inc 23/01/2030                         | 91 549           | 0,06              |
| 50 000 1.700% International Business Machines Corp 15/05/2027           | 44 803           | 0,03              | 30 000 2.625% Jefferies Financial Group Inc 15/10/2031                          | 23 211           | 0,01              |
| 50 000 4.150% International Business Machines Corp 27/07/2027           | 49 463           | 0,03              | 100 000 4.550% John Deere Capital Corp 11/10/2024                               | 100 156          | 0,06              |
| 50 000 6.220% International Business Machines Corp 01/08/2027           | 53 134           | 0,03              | 15 000 3.400% John Deere Capital Corp 06/06/2025                                | 14 690           | 0,01              |
| 160 000 3.500% International Business Machines Corp 15/05/2029          | 150 251          | 0,09              | 100 000 4.800% John Deere Capital Corp 09/01/2026                               | 101 521          | 0,06              |
| 100 000 4.400% International Business Machines Corp 27/07/2032          | 97 362           | 0,06              | 50 000 0.700% John Deere Capital Corp 15/01/2026                                | 45 432           | 0,03              |
| 200 000 4.750% International Business Machines Corp 06/02/2033          | 198 724          | 0,12              | 100 000 1.050% John Deere Capital Corp 17/06/2026                               | 90 348           | 0,06              |
| 40 000 4.450% International Flavors & Fragrances Inc 26/09/2028         | 38 251           | 0,02              | 25 000 2.250% John Deere Capital Corp 14/09/2026                                | 23 358           | 0,01              |
| 35 000 4.650% Interpublic Group of Cos Inc 01/10/2028                   | 34 265           | 0,02              | 15 000 2.350% John Deere Capital Corp 08/03/2027                                | 13 947           | 0,01              |
| 50 000 4.750% Interpublic Group of Cos Inc 30/03/2030                   | 49 127           | 0,03              | 40 000 1.750% John Deere Capital Corp 09/03/2027                                | 36 451           | 0,02              |
| 50 000 4.100% Interstate Power and Light Co 26/09/2028                  | 49 002           | 0,03              | 50 000 2.800% John Deere Capital Corp 08/09/2027                                | 47 011           | 0,03              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation | Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation | Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---------------|---|------------------|-------------------|---------------|---|------------------|-------------------|
|               | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |               | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
|               | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |               | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
|               | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |               | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 200 000       | 4.150% John Deere Capital Corp<br>15/09/2027                            | 198 958          | 0,12              | 20 000        | 3.200% JPMorgan Chase & Co<br>15/06/2026                                | 19 204           | 0,01              |
| 50 000        | 4.750% John Deere Capital Corp<br>20/01/2028                            | 51 062           | 0,03              | 25 000        | 1.045% JPMorgan Chase & Co<br>19/11/2026                                | 22 353           | 0,01              |
| 25 000        | 1.500% John Deere Capital Corp<br>06/03/2028                            | 21 981           | 0,01              | 140 000       | 1.578% JPMorgan Chase & Co<br>22/04/2027                                | 125 769          | 0,08              |
| 30 000        | 3.450% John Deere Capital Corp<br>07/03/2029                            | 28 893           | 0,02              | 20 000        | 8.000% JPMorgan Chase & Co<br>29/04/2027                                | 22 668           | 0,01              |
| 25 000        | 3.350% John Deere Capital Corp<br>18/04/2029                            | 23 735           | 0,01              | 240 000       | 1.470% JPMorgan Chase & Co<br>22/09/2027                                | 212 141          | 0,13              |
| 50 000        | 2.800% John Deere Capital Corp<br>18/07/2029                            | 45 699           | 0,03              | 200 000       | 3.625% JPMorgan Chase & Co<br>01/12/2027                                | 191 314          | 0,12              |
| 55 000        | 3.900% John Deere Capital Corp<br>07/06/2032                            | 52 965           | 0,03              | 130 000       | 3.782% JPMorgan Chase & Co<br>01/02/2028                                | 124 415          | 0,08              |
| 15 000        | 4.705% Johns Hopkins University<br>01/07/2032                           | 15 226           | 0,01              | 60 000        | 2.947% JPMorgan Chase & Co<br>24/02/2028                                | 55 669           | 0,03              |
| 50 000        | 2.625% Johnson & Johnson 15/01/2025                                     | 48 841           | 0,03              | 50 000        | 4.323% JPMorgan Chase & Co<br>26/04/2028                                | 48 841           | 0,03              |
| 140 000       | 2.450% Johnson & Johnson 01/03/2026                                     | 134 618          | 0,08              | 200 000       | 3.540% JPMorgan Chase & Co<br>01/05/2028                                | 189 218          | 0,12              |
| 50 000        | 0.950% Johnson & Johnson 01/09/2027                                     | 44 294           | 0,03              | 200 000       | 2.182% JPMorgan Chase & Co<br>01/06/2028                                | 179 290          | 0,11              |
| 70 000        | 2.900% Johnson & Johnson 15/01/2028                                     | 67 108           | 0,04              | 100 000       | 4.851% JPMorgan Chase & Co<br>25/07/2028                                | 99 839           | 0,06              |
| 35 000        | 1.300% Johnson & Johnson 01/09/2030                                     | 29 336           | 0,02              | 30 000        | 3.509% JPMorgan Chase & Co<br>23/01/2029                                | 28 097           | 0,02              |
| 75 000        | 3.900% Johnson Controls International plc<br>14/02/2026                 | 73 189           | 0,05              | 30 000        | 4.005% JPMorgan Chase & Co<br>23/04/2029                                | 28 668           | 0,02              |
| 120 000       | 3.875% JPMorgan Chase & Co<br>10/09/2024                                | 117 962          | 0,07              | 200 000       | 4.203% JPMorgan Chase & Co<br>23/07/2029                                | 193 146          | 0,12              |
| 250 000       | 0.824% JPMorgan Chase & Co<br>01/06/2025                                | 236 875          | 0,15              | 30 000        | 4.452% JPMorgan Chase & Co<br>05/12/2029                                | 29 143           | 0,02              |
| 175 000       | 3.845% JPMorgan Chase & Co<br>14/06/2025                                | 171 964          | 0,11              | 100 000       | 4.565% JPMorgan Chase & Co<br>14/06/2030                                | 97 339           | 0,06              |
| 280 000       | 0.969% JPMorgan Chase & Co<br>23/06/2025                                | 265 236          | 0,16              | 185 000       | 2.739% JPMorgan Chase & Co<br>15/10/2030                                | 161 440          | 0,10              |
| 25 000        | 3.900% JPMorgan Chase & Co<br>15/07/2025                                | 24 612           | 0,02              | 60 000        | 4.493% JPMorgan Chase & Co<br>24/03/2031                                | 58 339           | 0,04              |
| 10 000        | 2.301% JPMorgan Chase & Co<br>15/10/2025                                | 9 560            | 0,01              | 20 000        | 2.956% JPMorgan Chase & Co<br>13/05/2031                                | 17 223           | 0,01              |
| 50 000        | 1.561% JPMorgan Chase & Co<br>10/12/2025                                | 46 859           | 0,03              | 270 000       | 1.953% JPMorgan Chase & Co<br>04/02/2032                                | 217 228          | 0,13              |
| 220 000       | 5.546% JPMorgan Chase & Co<br>15/12/2025                                | 221 463          | 0,14              | 210 000       | 2.580% JPMorgan Chase & Co<br>22/04/2032                                | 176 889          | 0,11              |
| 100 000       | 2.595% JPMorgan Chase & Co<br>24/02/2026                                | 95 070           | 0,06              | 200 000       | 2.545% JPMorgan Chase & Co<br>08/11/2032                                | 166 020          | 0,10              |
| 212 000       | 2.005% JPMorgan Chase & Co<br>13/03/2026                                | 199 710          | 0,12              | 150 000       | 2.963% JPMorgan Chase & Co<br>25/01/2033                                | 128 395          | 0,08              |
| 40 000        | 3.300% JPMorgan Chase & Co<br>01/04/2026                                | 38 606           | 0,02              | 135 000       | 4.586% JPMorgan Chase & Co<br>26/04/2033                                | 130 818          | 0,08              |
| 270 000       | 2.083% JPMorgan Chase & Co<br>22/04/2026                                | 253 562          | 0,16              |               |   |                  |                   |
| 70 000        | 4.080% JPMorgan Chase & Co<br>26/04/2026                                | 68 666           | 0,04              |               |   |                  |                   |



## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 4.912% JPMorgan Chase & Co 25/07/2033                           | 99 427           | 0,06              |
| 245 000 5.717% JPMorgan Chase & Co 14/09/2033                           | 249 976          | 0,16              |
| 20 000 3.150% Kaiser Foundation Hospitals 01/05/2027                    | 18 854           | 0,01              |
| 15 000 2.875% Kansas City Southern/Old 15/11/2029                       | 13 445           | 0,01              |
| 75 000 3.400% Kellogg Co 15/11/2027                                     | 71 551           | 0,04              |
| 20 000 2.100% Kellogg Co 01/06/2030                                     | 16 760           | 0,01              |
| 20 000 5.250% Kellogg Co 01/03/2033                                     | 20 519           | 0,01              |
| 70 000 2.400% Kemper Corp 30/09/2030                                    | 55 993           | 0,03              |
| 70 000 3.800% Kemper Corp 23/02/2032                                    | 60 192           | 0,04              |
| 35 000 4.625% Kennametal Inc 15/06/2028                                 | 33 824           | 0,02              |
| 100 000 4.900% Kenvue Inc 22/03/2033                                    | 103 476          | 0,06              |
| 30 000 4.417% Keurig Dr Pepper Inc 25/05/2025                           | 29 665           | 0,02              |
| 120 000 3.400% Keurig Dr Pepper Inc 15/11/2025                          | 115 415          | 0,07              |
| 30 000 4.597% Keurig Dr Pepper Inc 25/05/2028                           | 29 936           | 0,02              |
| 40 000 3.950% Keurig Dr Pepper Inc 15/04/2029                           | 38 352           | 0,02              |
| 35 000 4.050% Keurig Dr Pepper Inc 15/04/2032                           | 33 155           | 0,02              |
| 50 000 4.150% KeyBank NA/Cleveland OH 08/08/2025                        | 47 375           | 0,03              |
| 20 000 6.950% KeyBank NA/Cleveland OH 01/02/2028                        | 20 297           | 0,01              |
| 50 000 3.900% KeyBank NA/Cleveland OH 13/04/2029                        | 42 505           | 0,03              |
| 150 000 5.000% KeyBank NA/Cleveland OH 26/01/2033                       | 139 287          | 0,09              |
| 70 000 2.250% KeyCorp 06/04/2027  | 59 466           | 0,04              |
| 30 000 4.100% KeyCorp 30/04/2028  | 26 908           | 0,02              |
| 20 000 4.789% KeyCorp 01/06/2033  | 17 929           | 0,01              |
| 115 000 4.600% Keysight Technologies Inc 06/04/2027                     | 113 872          | 0,07              |
| 40 000 3.000% Keysight Technologies Inc 30/10/2029                      | 35 379           | 0,02              |
| 40 000 4.250% Kilroy Realty LP 15/08/2029                               | 33 280           | 0,02              |
| 25 000 3.200% Kimberly-Clark Corp 25/04/2029                            | 23 687           | 0,01              |
| 50 000 3.100% Kimberly-Clark Corp 26/03/2030                            | 46 372           | 0,03              |
| 100 000 4.500% Kimberly-Clark Corp 16/02/2033                           | 101 287          | 0,06              |
| 100 000 2.800% Kimco Realty OP LLC 01/10/2026                           | 92 074           | 0,06              |
| 75 000 3.200% Kimco Realty OP LLC 01/04/2032                            | 63 196           | 0,04              |
| 100 000 4.250% Kinder Morgan Energy Partners LP 01/09/2024              | 98 866           | 0,06              |
| 100 000 4.300% Kinder Morgan Inc 01/06/2025                             | 98 514           | 0,06              |
| 10 000 2.000% Kinder Morgan Inc 15/02/2031                              | 8 071            | 0,00              |
| 30 000 7.800% Kinder Morgan Inc 01/08/2031                              | 34 370           | 0,02              |
| 100 000 7.750% Kinder Morgan Inc 15/01/2032                             | 116 230          | 0,07              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 4.500% Kinross Gold Corp 15/07/2027                              | 48 923           | 0,03              |
| 30 000 4.200% Kirby Corp 01/03/2028                                     | 28 218           | 0,02              |
| 50 000 4.650% KLA Corp 01/11/2024                                       | 49 865           | 0,03              |
| 35 000 4.100% KLA Corp 15/03/2029                                       | 34 460           | 0,02              |
| 30 000 4.650% KLA Corp 15/07/2032                                       | 30 274           | 0,02              |
| 50 000 3.875% Kraft Heinz Foods Co 15/05/2027                           | 48 805           | 0,03              |
| 70 000 3.750% Kraft Heinz Foods Co 01/04/2030                           | 66 340           | 0,04              |
| 100 000 4.250% Kraft Heinz Foods Co 01/03/2031                          | 96 881           | 0,06              |
| 50 000 3.500% Kroger Co 01/02/2026                                      | 48 795           | 0,03              |
| 25 000 2.650% Kroger Co 15/10/2026                                      | 23 547           | 0,01              |
| 130 000 2.200% Kroger Co 01/05/2030                                     | 109 061          | 0,07              |
| 30 000 3.832% L3Harris Technologies Inc 27/04/2025                      | 29 265           | 0,02              |
| 25 000 3.850% L3Harris Technologies Inc 15/12/2026                      | 24 400           | 0,02              |
| 35 000 4.400% L3Harris Technologies Inc 15/06/2028                      | 34 373           | 0,02              |
| 25 000 1.800% L3Harris Technologies Inc 15/01/2031                      | 20 202           | 0,01              |
| 55 000 2.300% Laboratory Corp of America Holdings 01/12/2024            | 52 573           | 0,03              |
| 70 000 2.950% Laboratory Corp of America Holdings 01/12/2029            | 62 578           | 0,04              |
| 75 000 2.700% Laboratory Corp of America Holdings 01/06/2031            | 64 534           | 0,04              |
| 50 000 4.000% Lam Research Corp 15/03/2029                              | 48 969           | 0,03              |
| 60 000 1.900% Lam Research Corp 15/06/2030                              | 50 546           | 0,03              |
| 20 000 3.750% Lazard Group LLC 13/02/2025                               | 19 460           | 0,01              |
| 10 000 4.500% Lazard Group LLC 19/09/2028                               | 9 582            | 0,01              |
| 70 000 4.375% Lazard Group LLC 11/03/2029                               | 66 331           | 0,04              |
| 25 000 4.250% Lear Corp 15/05/2029                                      | 23 666           | 0,01              |
| 50 000 3.500% Lear Corp 30/05/2030                                      | 44 105           | 0,03              |
| 30 000 4.750% Legg Mason Inc 15/03/2026                                 | 29 651           | 0,02              |
| 30 000 2.300% Leidos Inc 15/02/2031                                     | 24 388           | 0,02              |
| 45 000 5.750% Leidos Inc 15/03/2033                                     | 45 994           | 0,03              |
| 25 000 1.289% Leland Stanford Junior University 01/06/2027              | 22 286           | 0,01              |
| 55 000 5.875% Lennar Corp 15/11/2024                                    | 55 277           | 0,03              |
| 65 000 4.750% Lennar Corp 29/11/2027                                    | 64 277           | 0,04              |
| 50 000 2.400% Life Storage LP 15/10/2031                                | 40 333           | 0,02              |
| 200 000 3.400% Lincoln National Corp 15/01/2031                         | 163 398          | 0,10              |
| 100 000 1.100% Linde Inc/CT 10/08/2030                                  | 79 853           | 0,05              |
| 45 000 4.500% Lloyds Banking Group PLC 04/11/2024                       | 43 319           | 0,03              |
| 30 000 4.450% Lloyds Banking Group PLC 08/05/2025                       | 29 317           | 0,02              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 225 000 3.870% Lloyds Banking Group PLC 09/07/2025                      | 218 725          | 0,14              | 50 000 4.061% Manulife Financial Corp 24/02/2032                        | 47 442           | 0,03              |
| 50 000 4.582% Lloyds Banking Group PLC 10/12/2025                       | 47 485           | 0,03              | 50 000 3.703% Manulife Financial Corp 16/03/2032                        | 46 162           | 0,03              |
| 70 000 2.438% Lloyds Banking Group PLC 05/02/2026                       | 65 855           | 0,04              | 50 000 4.400% Marathon Oil Corp 15/07/2027                              | 48 473           | 0,03              |
| 70 000 4.650% Lloyds Banking Group PLC 24/03/2026                       | 66 629           | 0,04              | 110 000 4.700% Marathon Petroleum Corp 01/05/2025                       | 109 794          | 0,07              |
| 120 000 1.627% Lloyds Banking Group PLC 11/05/2027                      | 105 931          | 0,07              | 30 000 5.125% Marathon Petroleum Corp 15/12/2026                        | 30 268           | 0,02              |
| 100 000 3.750% Lloyds Banking Group PLC 18/03/2028                      | 92 948           | 0,06              | 40 000 5.750% Marriott International Inc/MD 01/05/2025                  | 40 456           | 0,02              |
| 50 000 4.375% Lloyds Banking Group PLC 22/03/2028                       | 47 574           | 0,03              | 55 000 3.125% Marriott International Inc/MD 15/06/2026                  | 51 915           | 0,03              |
| 100 000 5.871% Lloyds Banking Group PLC 06/03/2029                      | 100 875          | 0,06              | 40 000 5.000% Marriott International Inc/MD 15/10/2027                  | 40 091           | 0,02              |
| 60 000 4.976% Lloyds Banking Group PLC 11/08/2033                       | 57 471           | 0,04              | 10 000 4.900% Marriott International Inc/MD 15/04/2029                  | 9 924            | 0,01              |
| 80 000 3.550% Lockheed Martin Corp 15/01/2026                           | 79 192           | 0,05              | 30 000 4.625% Marriott International Inc/MD 15/06/2030                  | 29 110           | 0,02              |
| 50 000 3.900% Lockheed Martin Corp 15/06/2032                           | 48 474           | 0,03              | 65 000 2.850% Marriott International Inc/MD 15/04/2031                  | 55 388           | 0,03              |
| 80 000 5.250% Lockheed Martin Corp 15/01/2033                           | 85 316           | 0,05              | 50 000 3.500% Marriott International Inc/MD 15/10/2032                  | 43 825           | 0,03              |
| 50 000 4.000% Lowe's Cos Inc 15/04/2025                                 | 49 321           | 0,03              | 90 000 3.500% Marsh & McLennan Cos Inc 03/06/2024                       | 88 334           | 0,05              |
| 75 000 4.400% Lowe's Cos Inc 08/09/2025                                 | 74 525           | 0,05              | 50 000 3.750% Marsh & McLennan Cos Inc 14/03/2026                       | 48 923           | 0,03              |
| 60 000 3.350% Lowe's Cos Inc 01/04/2027                                 | 57 605           | 0,04              | 10 000 4.375% Marsh & McLennan Cos Inc 15/03/2029                       | 9 931            | 0,01              |
| 50 000 3.100% Lowe's Cos Inc 03/05/2027                                 | 47 486           | 0,03              | 25 000 5.750% Marsh & McLennan Cos Inc 01/11/2032                       | 26 807           | 0,02              |
| 70 000 1.300% Lowe's Cos Inc 15/04/2028                                 | 60 138           | 0,04              | 11 000 3.450% Martin Marietta Materials Inc 01/06/2027                  | 10 463           | 0,01              |
| 50 000 1.700% Lowe's Cos Inc 15/09/2028                                 | 43 284           | 0,03              | 15 000 2.500% Martin Marietta Materials Inc 15/03/2030                  | 12 743           | 0,01              |
| 30 000 3.650% Lowe's Cos Inc 05/04/2029                                 | 28 372           | 0,02              | 15 000 2.400% Martin Marietta Materials Inc 15/07/2031                  | 12 305           | 0,01              |
| 140 000 4.500% Lowe's Cos Inc 15/04/2030                                | 138 243          | 0,09              | 85 000 4.875% Marvell Technology Inc 22/06/2028                         | 83 585           | 0,05              |
| 50 000 1.700% Lowe's Cos Inc 15/10/2030                                 | 40 498           | 0,03              | 50 000 2.000% Masco Corp 01/10/2030                                     | 39 793           | 0,02              |
| 65 000 2.625% Lowe's Cos Inc 01/04/2031                                 | 55 494           | 0,03              | 25 000 2.000% Masco Corp 15/02/2031                                     | 19 989           | 0,01              |
| 35 000 3.500% LYB International Finance II BV 02/03/2027                | 33 554           | 0,02              | 100 000 2.000% Mastercard Inc 03/03/2025                                | 95 645           | 0,06              |
| 125 000 4.553% M&T Bank Corp 16/08/2028                                 | 115 507          | 0,07              | 30 000 2.950% Mastercard Inc 21/11/2026                                 | 28 737           | 0,02              |
| 10 000 5.000% Magellan Midstream Partners LP 01/03/2026                 | 10 085           | 0,01              | 30 000 3.300% Mastercard Inc 26/03/2027                                 | 29 058           | 0,02              |
| 64 000 3.250% Magellan Midstream Partners LP 01/06/2030                 | 57 734           | 0,04              | 55 000 2.950% Mastercard Inc 01/06/2029                                 | 51 077           | 0,03              |
| 80 000 2.450% Magna International Inc 15/06/2030                        | 67 908           | 0,04              | 75 000 3.350% Mastercard Inc 26/03/2030                                 | 71 388           | 0,04              |
| 125 000 5.500% Magna International Inc 21/03/2033                       | 129 896          | 0,08              | 9 000 3.150% McCormick & Co Inc/MD 15/08/2024                           | 8 763            | 0,01              |
| 20 000 3.000% Main Street Capital Corp 14/07/2026                       | 17 511           | 0,01              | 25 000 0.900% McCormick & Co Inc/MD 15/02/2026                          | 22 429           | 0,01              |
| 50 000 4.650% Manufacturers & Traders Trust Co 27/01/2026               | 47 082           | 0,03              |   |                  |                   |
| 50 000 2.484% Manulife Financial Corp 19/05/2027                        | 46 164           | 0,03              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 3.400% McCormick & Co Inc/MD 15/08/2027                         | 94 819           | 0,06              |
| 40 000 2.500% McCormick & Co Inc/MD 15/04/2030                          | 34 214           | 0,02              |
| 15 000 3.300% McDonald's Corp 01/07/2025                                | 14 695           | 0,01              |
| 100 000 3.700% McDonald's Corp 30/01/2026                               | 98 312           | 0,06              |
| 1 000 3.500% McDonald's Corp 01/03/2027                                 | 971              | 0,00              |
| 30 000 3.500% McDonald's Corp 01/07/2027                                | 29 089           | 0,02              |
| 80 000 3.800% McDonald's Corp 01/04/2028                                | 78 546           | 0,05              |
| 65 000 2.625% McDonald's Corp 01/09/2029                                | 59 020           | 0,04              |
| 50 000 2.125% McDonald's Corp 01/03/2030                                | 43 228           | 0,03              |
| 40 000 4.600% McDonald's Corp 09/09/2032                                | 40 466           | 0,03              |
| 40 000 1.300% McKesson Corp 15/08/2026                                  | 35 842           | 0,02              |
| 65 000 4.250% Medtronic Global Holdings SCA 30/03/2028                  | 64 884           | 0,04              |
| 70 000 8.500% Mercedes-Benz Finance North America LLC 18/01/2031        | 88 768           | 0,05              |
| 87 000 2.750% Merck & Co Inc 10/02/2025                                 | 85 121           | 0,05              |
| 100 000 1.700% Merck & Co Inc 10/06/2027                                | 90 892           | 0,06              |
| 50 000 1.900% Merck & Co Inc 10/12/2028                                 | 44 450           | 0,03              |
| 105 000 3.400% Merck & Co Inc 07/03/2029                                | 100 941          | 0,06              |
| 100 000 2.150% Merck & Co Inc 10/12/2031                                | 84 479           | 0,05              |
| 25 000 5.950% Merck Sharp & Dohme Corp 01/12/2028                       | 27 163           | 0,02              |
| 100 000 3.500% Meta Platforms Inc 15/08/2027                            | 96 535           | 0,06              |
| 150 000 3.850% Meta Platforms Inc 15/08/2032                            | 140 487          | 0,09              |
| 30 000 3.600% MetLife Inc 10/04/2024                                    | 29 575           | 0,02              |
| 10 000 3.000% MetLife Inc 01/03/2025                                    | 9 676            | 0,01              |
| 50 000 6.500% MetLife Inc 15/12/2032                                    | 55 643           | 0,03              |
| 140 000 0.983% Microchip Technology Inc 01/09/2024                      | 131 930          | 0,08              |
| 50 000 4.185% Micron Technology Inc 15/02/2027                          | 48 305           | 0,03              |
| 70 000 5.327% Micron Technology Inc 06/02/2029                          | 70 276           | 0,04              |
| 25 000 6.750% Micron Technology Inc 01/11/2029                          | 26 598           | 0,02              |
| 30 000 4.663% Micron Technology Inc 15/02/2030                          | 28 798           | 0,02              |
| 20 000 2.703% Micron Technology Inc 15/04/2032                          | 16 004           | 0,01              |
| 30 000 5.875% Micron Technology Inc 09/02/2033                          | 30 339           | 0,02              |
| 170 000 2.700% Microsoft Corp 12/02/2025                                | 165 758          | 0,10              |
| 110 000 3.125% Microsoft Corp 03/11/2025                                | 107 298          | 0,07              |
| 95 000 2.400% Microsoft Corp 08/08/2026                                 | 90 352           | 0,06              |
| 90 000 3.300% Microsoft Corp 06/02/2027                                 | 88 294           | 0,05              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 10 000 3.750% Mid-America Apartments LP 15/06/2024                      | 9 858            | 0,01              |
| 30 000 3.600% Mid-America Apartments LP 01/06/2027                      | 28 626           | 0,02              |
| 20 000 2.750% Mid-America Apartments LP 15/03/2030                      | 17 524           | 0,01              |
| 40 000 1.700% Mid-America Apartments LP 15/02/2031                      | 31 722           | 0,02              |
| 30 000 3.500% MidAmerican Energy Co 15/10/2024                          | 29 381           | 0,02              |
| 25 000 3.650% MidAmerican Energy Co 15/04/2029                          | 23 888           | 0,01              |
| 50 000 3.950% Mississippi Power Co 30/03/2028                           | 48 159           | 0,03              |
| 375 000 0.953% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 19/07/2025            | 353 122          | 0,22              |
| 70 000 5.063% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 12/09/2025             | 69 489           | 0,04              |
| 200 000 0.962% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 11/10/2025            | 186 258          | 0,12              |
| 110 000 3.850% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 01/03/2026            | 105 471          | 0,07              |
| 60 000 3.837% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 17/04/2026             | 58 040           | 0,04              |
| 250 000 2.757% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 13/09/2026            | 231 015          | 0,14              |
| 75 000 1.538% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 20/07/2027             | 66 323           | 0,04              |
| 13 000 1.640% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 13/10/2027             | 11 429           | 0,01              |
| 50 000 2.341% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 19/01/2028             | 44 898           | 0,03              |
| 75 000 3.961% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 02/03/2028             | 72 251           | 0,04              |
| 70 000 5.017% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 20/07/2028             | 69 459           | 0,04              |
| 50 000 5.422% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 22/02/2029             | 50 459           | 0,03              |
| 40 000 3.741% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 07/03/2029             | 37 428           | 0,02              |
| 70 000 3.195% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 18/07/2029             | 62 513           | 0,04              |
| 50 000 2.559% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 25/02/2030             | 42 529           | 0,03              |
| 50 000 2.048% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 17/07/2030             | 40 738           | 0,03              |
| 130 000 2.309% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 20/07/2032            | 104 162          | 0,06              |
| 50 000 2.494% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 13/10/2032             | 40 371           | 0,02              |
| 40 000 2.852% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 19/01/2033             | 33 013           | 0,02              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 5.133% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 20/07/2033            | 98 639           | 0,06              |
| 40 000 2.839% Mizuho Financial Group Inc 16/07/2025                     | 38 512           | 0,02              |
| 30 000 3.663% Mizuho Financial Group Inc 28/02/2027                     | 28 448           | 0,02              |
| 70 000 1.554% Mizuho Financial Group Inc 09/07/2027                     | 61 824           | 0,04              |
| 70 000 4.018% Mizuho Financial Group Inc 05/03/2028                     | 66 097           | 0,04              |
| 100 000 5.414% Mizuho Financial Group Inc 13/09/2028                    | 100 393          | 0,06              |
| 50 000 4.254% Mizuho Financial Group Inc 11/09/2029                     | 47 205           | 0,03              |
| 20 000 3.153% Mizuho Financial Group Inc 16/07/2030                     | 17 584           | 0,01              |
| 30 000 2.869% Mizuho Financial Group Inc 13/09/2030                     | 25 854           | 0,02              |
| 260 000 2.591% Mizuho Financial Group Inc 25/05/2031                    | 216 346          | 0,13              |
| 10 000 1.979% Mizuho Financial Group Inc 08/09/2031                     | 7 894            | 0,00              |
| 70 000 2.260% Mizuho Financial Group Inc 09/07/2032                     | 55 116           | 0,03              |
| 25 000 3.625% Mohawk Industries Inc 15/05/2030                          | 22 583           | 0,01              |
| 50 000 1.500% Mondelez International Inc 04/05/2025                     | 46 780           | 0,03              |
| 55 000 2.625% Mondelez International Inc 17/03/2027                     | 51 375           | 0,03              |
| 30 000 2.750% Mondelez International Inc 13/04/2030                     | 26 618           | 0,02              |
| 25 000 3.000% Mondelez International Inc 17/03/2032                     | 22 008           | 0,01              |
| 30 000 4.250% Moody's Corp 01/02/2029                                   | 29 311           | 0,02              |
| 50 000 4.250% Moody's Corp 08/08/2032                                   | 48 153           | 0,03              |
| 30 000 3.700% Morgan Stanley 23/10/2024                                 | 29 473           | 0,02              |
| 220 000 3.620% Morgan Stanley 17/04/2025                                | 215 934          | 0,13              |
| 300 000 0.790% Morgan Stanley 30/05/2025                                | 284 064          | 0,18              |
| 80 000 2.720% Morgan Stanley 22/07/2025                                 | 77 174           | 0,05              |
| 40 000 4.000% Morgan Stanley 23/07/2025                                 | 39 226           | 0,02              |
| 100 000 0.864% Morgan Stanley 21/10/2025                                | 92 925           | 0,06              |
| 40 000 5.000% Morgan Stanley 24/11/2025                                 | 39 804           | 0,02              |
| 50 000 3.875% Morgan Stanley 27/01/2026                                 | 48 857           | 0,03              |
| 100 000 2.630% Morgan Stanley 18/02/2026                                | 94 974           | 0,06              |
| 245 000 2.188% Morgan Stanley 28/04/2026                                | 230 222          | 0,14              |
| 100 000 6.250% Morgan Stanley 09/08/2026                                | 104 441          | 0,06              |
| 40 000 4.350% Morgan Stanley 08/09/2026                                 | 39 022           | 0,02              |
| 70 000 0.985% Morgan Stanley 10/12/2026                                 | 62 389           | 0,04              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 80 000 3.625% Morgan Stanley 20/01/2027                                 | 76 989           | 0,05              |
| 60 000 5.050% Morgan Stanley 28/01/2027                                 | 59 887           | 0,04              |
| 280 000 3.950% Morgan Stanley 23/04/2027                                | 270 486          | 0,17              |
| 50 000 1.593% Morgan Stanley 04/05/2027                                 | 45 029           | 0,03              |
| 178 000 1.512% Morgan Stanley 20/07/2027                                | 157 952          | 0,10              |
| 60 000 2.475% Morgan Stanley 21/01/2028                                 | 54 860           | 0,03              |
| 25 000 4.210% Morgan Stanley 20/04/2028                                 | 24 287           | 0,01              |
| 260 000 3.591% Morgan Stanley 22/07/2028                                | 245 773          | 0,15              |
| 500 000 6.296% Morgan Stanley 18/10/2028                                | 525 955          | 0,33              |
| 100 000 3.772% Morgan Stanley 24/01/2029                                | 94 751           | 0,06              |
| 65 000 5.123% Morgan Stanley 01/02/2029                                 | 65 407           | 0,04              |
| 210 000 4.431% Morgan Stanley 23/01/2030                                | 202 125          | 0,13              |
| 180 000 2.699% Morgan Stanley 22/01/2031                                | 154 966          | 0,10              |
| 20 000 3.622% Morgan Stanley 01/04/2031                                 | 18 310           | 0,01              |
| 100 000 1.794% Morgan Stanley 13/02/2032                                | 78 517           | 0,05              |
| 100 000 1.928% Morgan Stanley 28/04/2032                                | 79 071           | 0,05              |
| 180 000 2.239% Morgan Stanley 21/07/2032                                | 144 790          | 0,09              |
| 35 000 2.511% Morgan Stanley 20/10/2032                                 | 28 648           | 0,02              |
| 115 000 2.943% Morgan Stanley 21/01/2033                                | 97 471           | 0,06              |
| 60 000 4.889% Morgan Stanley 20/07/2033                                 | 58 893           | 0,04              |
| 50 000 2.484% Morgan Stanley 16/09/2036                                 | 37 814           | 0,02              |
| 50 000 5.297% Morgan Stanley 20/04/2037                                 | 47 127           | 0,03              |
| 100 000 5.948% Morgan Stanley 19/01/2038                                | 99 220           | 0,06              |
| 50 000 4.500% Morgan Stanley Domestic Holdings Inc 20/06/2028           | 49 415           | 0,03              |
| 15 000 4.600% Motorola Solutions Inc 23/02/2028                         | 14 806           | 0,01              |
| 70 000 4.600% Motorola Solutions Inc 23/05/2029                         | 68 225           | 0,04              |
| 40 000 2.300% Motorola Solutions Inc 15/11/2030                         | 32 499           | 0,02              |
| 10 000 2.750% Motorola Solutions Inc 24/05/2031                         | 8 222            | 0,00              |
| 25 000 5.600% Motorola Solutions Inc 01/06/2032                         | 25 144           | 0,02              |
| 30 000 4.875% MPLX LP 01/12/2024  | 29 819           | 0,02              |
| 50 000 4.875% MPLX LP 01/06/2025  | 49 653           | 0,03              |
| 190 000 1.750% MPLX LP 01/03/2026                                       | 173 487          | 0,11              |
| 50 000 4.250% MPLX LP 01/12/2027  | 48 522           | 0,03              |
| 60 000 4.000% MPLX LP 15/03/2028  | 57 426           | 0,04              |
| 25 000 2.650% MPLX LP 15/08/2030  | 21 238           | 0,01              |
| 50 000 4.950% MPLX LP 01/09/2032  | 48 982           | 0,03              |
| 55 000 3.850% Nasdaq Inc 30/06/2026                                     | 53 652           | 0,03              |
| 150 000 3.500% National Australia Bank Ltd/New York 09/06/2025          | 146 158          | 0,09              |
| 50 000 3.375% National Australia Bank Ltd/New York 14/01/2026           | 48 287           | 0,03              |
| 120 000 2.500% National Australia Bank Ltd/New York 12/07/2026          | 112 078          | 0,07              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>           |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>     |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                                   |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 3.905% National Australia Bank Ltd/New York 09/06/2027              | 97 086           | 0,06              | 5 000 3.500% NextEra Energy Capital Holdings Inc 01/04/2029             | 4 694            | 0,00              |
| 100 000 5.250% National Bank of Canada 17/01/2025                           | 99 843           | 0,06              | 150 000 2.750% NextEra Energy Capital Holdings Inc 01/11/2029           | 133 402          | 0,08              |
| 50 000 3.750% National Bank of Canada 09/06/2025                            | 48 918           | 0,03              | 30 000 2.250% NextEra Energy Capital Holdings Inc 01/06/2030            | 25 358           | 0,02              |
| 25 000 5.500% National Fuel Gas Co 15/01/2026                               | 25 000           | 0,02              | 50 000 2.440% NextEra Energy Capital Holdings Inc 15/01/2032            | 41 458           | 0,03              |
| 50 000 2.950% National Fuel Gas Co 01/03/2031                               | 40 181           | 0,02              | 115 000 5.000% NextEra Energy Capital Holdings Inc 15/07/2032           | 115 954          | 0,07              |
| 35 000 2.500% National Retail Properties Inc 15/04/2030                     | 29 181           | 0,02              | 50 000 5.050% NextEra Energy Capital Holdings Inc 28/02/2033            | 50 139           | 0,03              |
| 20 000 1.000% National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 18/10/2024  | 18 807           | 0,01              | 35 000 4.800% NextEra Energy Capital Holdings Inc 01/12/2077            | 29 513           | 0,02              |
| 100 000 2.850% National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 27/01/2025 | 96 786           | 0,06              | 50 000 2.400% NIKE Inc 27/03/2025                                       | 48 534           | 0,03              |
| 80 000 1.875% National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 07/02/2025  | 75 931           | 0,05              | 100 000 2.750% NIKE Inc 27/03/2027                                      | 95 084           | 0,06              |
| 30 000 3.450% National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 15/06/2025  | 29 133           | 0,02              | 100 000 0.950% NiSource Inc 15/08/2025                                  | 91 312           | 0,06              |
| 50 000 4.450% National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 13/03/2026  | 49 961           | 0,03              | 65 000 3.490% NiSource Inc 15/05/2027                                   | 61 627           | 0,04              |
| 50 000 4.800% National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 15/03/2028  | 50 497           | 0,03              | 25 000 5.250% NiSource Inc 30/03/2028                                   | 25 507           | 0,02              |
| 20 000 4.800% NatWest Group PLC 05/04/2026                                  | 19 508           | 0,01              | 170 000 2.648% Nomura Holdings Inc 16/01/2025                           | 161 055          | 0,10              |
| 50 000 1.642% NatWest Group PLC 14/06/2027                                  | 44 065           | 0,03              | 20 000 1.851% Nomura Holdings Inc 16/07/2025                            | 18 324           | 0,01              |
| 50 000 3.073% NatWest Group PLC 22/05/2028                                  | 45 255           | 0,03              | 200 000 1.653% Nomura Holdings Inc 14/07/2026                           | 175 544          | 0,11              |
| 100 000 5.516% NatWest Group PLC 30/09/2028                                 | 99 170           | 0,06              | 100 000 2.329% Nomura Holdings Inc 22/01/2027                           | 88 396           | 0,05              |
| 140 000 4.892% NatWest Group PLC 18/05/2029                                 | 134 681          | 0,08              | 50 000 2.172% Nomura Holdings Inc 14/07/2028                            | 41 823           | 0,03              |
| 150 000 5.076% NatWest Group PLC 27/01/2030                                 | 145 692          | 0,09              | 40 000 3.103% Nomura Holdings Inc 16/01/2030                            | 33 757           | 0,02              |
| 30 000 4.445% NatWest Group PLC 08/05/2030                                  | 28 099           | 0,02              | 30 000 2.999% Nomura Holdings Inc 22/01/2032                            | 24 002           | 0,01              |
| 10 000 3.300% NetApp Inc 29/09/2024   | 9 729            | 0,01              | 20 000 3.650% Norfolk Southern Corp 01/08/2025                          | 19 468           | 0,01              |
| 80 000 2.700% NetApp Inc 22/06/2030   | 68 723           | 0,04              | 50 000 2.900% Norfolk Southern Corp 15/06/2026                          | 47 522           | 0,03              |
| 100 000 5.875% Netflix Inc 15/02/2025                                       | 102 078          | 0,06              | 45 000 2.550% Norfolk Southern Corp 01/11/2029                          | 39 625           | 0,02              |
| 200 000 6.375% Netflix Inc 15/05/2029                                       | 215 182          | 0,13              | 50 000 4.000% Northern Trust Corp 10/05/2027                            | 48 967           | 0,03              |
| 25 000 3.700% Nevada Power Co 01/05/2029                                    | 24 034           | 0,01              | 86 000 3.375% Northern Trust Corp 08/05/2032                            | 77 738           | 0,05              |
| 60 000 2.400% Nevada Power Co 01/05/2030                                    | 52 021           | 0,03              | 50 000 6.125% Northern Trust Corp 02/11/2032                            | 53 277           | 0,03              |
| 25 000 2.700% NewMarket Corp 18/03/2031                                     | 20 801           | 0,01              | 155 000 2.930% Northrop Grumman Corp 15/01/2025                         | 150 255          | 0,09              |
| 100 000 2.250% Newmont Corp 01/10/2030                                      | 83 957           | 0,05              | 35 000 3.250% Northrop Grumman Corp 15/01/2028                          | 33 259           | 0,02              |
| 55 000 6.051% NextEra Energy Capital Holdings Inc 01/03/2025                | 55 965           | 0,03              | 50 000 3.600% NOV Inc 01/12/2029  | 45 248           | 0,03              |
| 30 000 4.450% NextEra Energy Capital Holdings Inc 20/06/2025                | 29 868           | 0,02              | 60 000 3.400% Novartis Capital Corp 06/05/2024                          | 59 240           | 0,04              |
| 20 000 3.550% NextEra Energy Capital Holdings Inc 01/05/2027                | 19 153           | 0,01              | 20 000 1.750% Novartis Capital Corp 14/02/2025                          | 19 074           | 0,01              |
| 160 000 4.625% NextEra Energy Capital Holdings Inc 15/07/2027               | 159 613          | 0,10              | 50 000 3.000% Novartis Capital Corp 20/11/2025                          | 48 561           | 0,03              |
| 50 000 1.900% NextEra Energy Capital Holdings Inc 15/06/2028                | 43 983           | 0,03              | 95 000 2.000% Novartis Capital Corp 14/02/2027                          | 87 710           | 0,05              |
|   |                  |                   | 60 000 3.100% Novartis Capital Corp 17/05/2027                          | 57 711           | 0,04              |
|   |                  |                   | 90 000 3.950% Nucor Corp 23/05/2025                                     | 88 634           | 0,05              |
|   |                  |                   | 75 000 3.125% Nucor Corp 01/04/2032                                     | 66 230           | 0,04              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 4.000% Nutrien Ltd 15/12/2026                                    | 48 408           | 0,03              | 50 000 3.100% ONEOK Inc 15/03/2030                                      | 43 781           | 0,03              |
| 25 000 4.900% Nutrien Ltd 27/03/2028                                    | 25 025           | 0,02              | 50 000 6.350% ONEOK Inc 15/01/2031                                      | 52 232           | 0,03              |
| 10 000 4.200% Nutrien Ltd 01/04/2029                                    | 9 653            | 0,01              | 20 000 6.100% ONEOK Inc 15/11/2032                                      | 20 713           | 0,01              |
| 30 000 2.950% Nutrien Ltd 13/05/2030                                    | 26 375           | 0,02              | 30 000 4.900% ONEOK Partners LP 15/03/2025                              | 29 817           | 0,02              |
| 25 000 2.750% nVent Finance Sarl 15/11/2031                             | 20 511           | 0,01              | 175 000 2.950% Oracle Corp 15/11/2024                                   | 170 035          | 0,11              |
| 50 000 0.584% NVIDIA Corp 14/06/2024                                    | 47 751           | 0,03              | 70 000 2.500% Oracle Corp 01/04/2025                                    | 66 967           | 0,04              |
| 50 000 1.550% NVIDIA Corp 15/06/2028                                    | 44 070           | 0,03              | 115 000 2.950% Oracle Corp 15/05/2025                                   | 110 736          | 0,07              |
| 90 000 2.850% NVIDIA Corp 01/04/2030                                    | 81 918           | 0,05              | 100 000 1.650% Oracle Corp 25/03/2026                                   | 91 877           | 0,06              |
| 55 000 2.000% NVIDIA Corp 15/06/2031                                    | 46 191           | 0,03              | 328 000 2.650% Oracle Corp 15/07/2026                                   | 306 464          | 0,19              |
| 60 000 3.000% NVR Inc 15/05/2030  | 52 838           | 0,03              | 200 000 2.800% Oracle Corp 01/04/2027                                   | 185 894          | 0,12              |
| 50 000 5.550% NXP BV / NXP Funding LLC 01/12/2028                       | 51 091           | 0,03              | 85 000 2.300% Oracle Corp 25/03/2028                                    | 76 067           | 0,05              |
| 110 000 2.700% NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 01/05/2025        | 104 327          | 0,06              | 35 000 4.500% Oracle Corp 06/05/2028                                    | 34 588           | 0,02              |
| 90 000 3.875% NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 18/06/2026         | 86 853           | 0,05              | 50 000 6.150% Oracle Corp 09/11/2029                                    | 53 266           | 0,03              |
| 20 000 4.400% NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 01/06/2027         | 19 762           | 0,01              | 105 000 2.950% Oracle Corp 01/04/2030                                   | 92 699           | 0,06              |
| 40 000 4.300% NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 18/06/2029         | 38 352           | 0,02              | 355 000 2.875% Oracle Corp 25/03/2031                                   | 303 788          | 0,19              |
| 50 000 2.500% NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 11/05/2031         | 41 350           | 0,03              | 35 000 4.900% Oracle Corp 06/02/2033                                    | 34 275           | 0,02              |
| 50 000 2.700% Oaktree Specialty Lending Corp 15/01/2027                 | 42 585           | 0,03              | 120 000 9.000% Orange SA 01/03/2031                                     | 150 871          | 0,09              |
| 15 000 2.510% Ochsner LSU Health System of North Louisiana 15/05/2031   | 11 211           | 0,01              | 25 000 3.550% O'Reilly Automotive Inc 15/03/2026                        | 24 338           | 0,01              |
| 50 000 2.297% OhioHealth Corp 15/11/2031                                | 41 440           | 0,03              | 50 000 4.350% O'Reilly Automotive Inc 01/06/2028                        | 49 491           | 0,03              |
| 15 000 3.250% Oklahoma Gas and Electric Co 01/04/2030                   | 13 553           | 0,01              | 40 000 3.900% O'Reilly Automotive Inc 01/06/2029                        | 38 244           | 0,02              |
| 35 000 5.400% Oklahoma Gas and Electric Co 15/01/2033                   | 36 229           | 0,02              | 30 000 3.250% ORIX Corp 04/12/2024                                      | 29 082           | 0,02              |
| 50 000 5.250% Omega Healthcare Investors Inc 15/01/2026                 | 49 102           | 0,03              | 20 000 5.000% ORIX Corp 13/09/2027                                      | 19 981           | 0,01              |
| 60 000 3.625% Omega Healthcare Investors Inc 01/10/2029                 | 50 375           | 0,03              | 50 000 4.000% ORIX Corp 13/04/2032                                      | 45 883           | 0,03              |
| 20 000 3.375% Omega Healthcare Investors Inc 01/02/2031                 | 15 909           | 0,01              | 70 000 2.056% Otis Worldwide Corp 05/04/2025                            | 66 127           | 0,04              |
| 150 000 4.200% Omnicom Group Inc 01/06/2030                             | 144 217          | 0,09              | 50 000 5.375% Ovintiv Exploration Inc 01/01/2026                        | 50 162           | 0,03              |
| 20 000 2.600% Omnicom Group Inc 01/08/2031                              | 17 012           | 0,01              | 35 000 3.400% Owens Corning 15/08/2026                                  | 33 324           | 0,02              |
| 30 000 3.650% Omnicom Group Inc / Omnicom Capital Inc 01/11/2024        | 29 402           | 0,02              | 50 000 3.750% Owl Rock Capital Corp 22/07/2025                          | 45 805           | 0,03              |
| 50 000 3.700% Oncor Electric Delivery Co LLC 15/11/2028                 | 48 492           | 0,03              | 25 000 4.250% Owl Rock Capital Corp 15/01/2026                          | 22 985           | 0,01              |
| 100 000 5.750% Oncor Electric Delivery Co LLC 15/03/2029                | 106 042          | 0,07              | 80 000 3.400% Owl Rock Capital Corp 15/07/2026                          | 70 804           | 0,04              |
| 50 000 4.000% ONEOK Inc 13/07/2027                                      | 47 792           | 0,03              | 25 000 2.625% Owl Rock Capital Corp 15/01/2027                          | 21 166           | 0,01              |
| 50 000 4.550% ONEOK Inc 15/07/2028                                      | 48 335           | 0,03              | 150 000 4.700% OWL Rock Core Income Corp 08/02/2027                     | 136 198          | 0,08              |
| 20 000 4.350% ONEOK Inc 15/03/2029                                      | 18 927           | 0,01              | 110 000 2.850% PACCAR Financial Corp 07/04/2025                         | 106 275          | 0,07              |
|   |                  |                   | 20 000 1.100% PACCAR Financial Corp 11/05/2026                          | 18 085           | 0,01              |
|   |                  |                   | 10 000 4.600% PACCAR Financial Corp 10/01/2028                          | 10 159           | 0,01              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 3.400% Pacific Gas and Electric Co 15/08/2024                   | 97 197           | 0,06              |
| 10 000 3.150% Pacific Gas and Electric Co 01/01/2026                    | 9 327            | 0,01              |
| 80 000 2.950% Pacific Gas and Electric Co 01/03/2026                    | 74 325           | 0,05              |
| 50 000 4.650% Pacific Gas and Electric Co 01/08/2028                    | 47 052           | 0,03              |
| 90 000 4.200% Pacific Gas and Electric Co 01/03/2029                    | 82 962           | 0,05              |
| 40 000 4.550% Pacific Gas and Electric Co 01/07/2030                    | 37 397           | 0,02              |
| 80 000 2.500% Pacific Gas and Electric Co 01/02/2031                    | 64 748           | 0,04              |
| 30 000 3.250% Pacific Gas and Electric Co 01/06/2031                    | 25 492           | 0,02              |
| 255 000 5.900% Pacific Gas and Electric Co 15/06/2032                   | 255 036          | 0,16              |
| 60 000 3.400% Packaging Corp of America 15/12/2027                      | 57 048           | 0,04              |
| 90 000 4.000% Paramount Global 15/01/2026                               | 87 172           | 0,05              |
| 25 000 7.875% Paramount Global 30/07/2030                               | 27 588           | 0,02              |
| 50 000 4.950% Paramount Global 15/01/2031                               | 46 101           | 0,03              |
| 130 000 4.200% Paramount Global 19/05/2032                              | 111 683          | 0,07              |
| 50 000 3.650% Parker-Hannifin Corp 15/06/2024                           | 49 259           | 0,03              |
| 50 000 3.250% Parker-Hannifin Corp 01/03/2027                           | 47 563           | 0,03              |
| 70 000 4.250% Parker-Hannifin Corp 15/09/2027                           | 68 811           | 0,04              |
| 30 000 3.250% Parker-Hannifin Corp 14/06/2029                           | 27 640           | 0,02              |
| 50 000 4.500% Parker-Hannifin Corp 15/09/2029                           | 49 669           | 0,03              |
| 40 000 2.400% PayPal Holdings Inc 01/10/2024                            | 38 735           | 0,02              |
| 30 000 1.650% PayPal Holdings Inc 01/06/2025                            | 28 155           | 0,02              |
| 75 000 2.650% PayPal Holdings Inc 01/10/2026                            | 70 723           | 0,04              |
| 50 000 2.300% PayPal Holdings Inc 01/06/2030                            | 42 866           | 0,03              |
| 30 000 4.400% PayPal Holdings Inc 01/06/2032                            | 29 424           | 0,02              |
| 75 000 2.250% PepsiCo Inc 19/03/2025                                    | 72 378           | 0,04              |
| 15 000 2.850% PepsiCo Inc 24/02/2026                                    | 14 515           | 0,01              |
| 75 000 2.375% PepsiCo Inc 06/10/2026                                    | 70 793           | 0,04              |
| 50 000 3.000% PepsiCo Inc 15/10/2027                                    | 47 864           | 0,03              |
| 50 000 3.600% PepsiCo Inc 18/02/2028                                    | 49 052           | 0,03              |
| 50 000 4.450% PepsiCo Inc 15/05/2028                                    | 50 989           | 0,03              |
| 45 000 7.000% PepsiCo Inc 01/03/2029                                    | 52 376           | 0,03              |
| 65 000 2.625% PepsiCo Inc 29/07/2029                                    | 59 669           | 0,04              |
| 50 000 2.750% PepsiCo Inc 19/03/2030                                    | 45 658           | 0,03              |
| 80 000 1.625% PepsiCo Inc 01/05/2030                                    | 67 648           | 0,04              |
| 125 000 3.900% PepsiCo Inc 18/07/2032                                   | 122 192          | 0,08              |
| 40 000 1.900% PerkinElmer Inc 15/09/2028                                | 34 268           | 0,02              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>                   |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>             |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 95 000 3.300% PerkinElmer Inc 15/09/2029  | 84 944           | 0,05              |
| 20 000 2.250% PerkinElmer Inc 15/09/2031  | 16 031           | 0,01              |
| 30 000 3.400% Pfizer Inc 15/05/2024   | 29 585           | 0,02              |
| 50 000 0.800% Pfizer Inc 28/05/2025   | 46 475           | 0,03              |
| 50 000 2.750% Pfizer Inc 03/06/2026   | 47 960           | 0,03              |
| 20 000 3.000% Pfizer Inc 15/12/2026   | 19 268           | 0,01              |
| 200 000 3.600% Pfizer Inc 15/09/2028  | 196 008          | 0,12              |
| 65 000 1.750% Pfizer Inc 18/08/2031   | 53 591           | 0,03              |
| 30 000 1.500% Philip Morris International Inc 01/05/2025                            | 28 081           | 0,02              |
| 55 000 2.750% Philip Morris International Inc 25/02/2026                            | 52 122           | 0,03              |
| 85 000 0.875% Philip Morris International Inc 01/05/2026                            | 76 232           | 0,05              |
| 20 000 3.125% Philip Morris International Inc 17/08/2027                            | 18 932           | 0,01              |
| 50 000 3.125% Philip Morris International Inc 02/03/2028                            | 46 703           | 0,03              |
| 225 000 5.625% Philip Morris International Inc 17/11/2029                           | 235 165          | 0,15              |
| 150 000 5.125% Philip Morris International Inc 15/02/2030                           | 151 608          | 0,09              |
| 100 000 5.750% Philip Morris International Inc 17/11/2032                           | 104 904          | 0,07              |
| 25 000 3.850% Phillips 66 09/04/2025  | 24 443           | 0,02              |
| 25 000 4.950% Phillips 66 01/12/2027  | 25 140           | 0,02              |
| 80 000 3.900% Phillips 66 15/03/2028  | 77 038           | 0,05              |
| 140 000 2.150% Phillips 66 15/12/2030   | 115 566          | 0,07              |
| 110 000 2.625% Phillips Edison Grocery Center Operating Partnership I LP 15/11/2031 | 82 048           | 0,05              |
| 30 000 2.625% Physicians Realty LP 01/11/2031                                       | 23 920           | 0,01              |
| 50 000 3.500% Piedmont Natural Gas Co Inc 01/06/2029                                | 46 455           | 0,03              |
| 20 000 2.500% Piedmont Natural Gas Co Inc 15/03/2031                                | 16 674           | 0,01              |
| 45 000 3.150% Piedmont Operating Partnership LP 15/08/2030                          | 33 275           | 0,02              |
| 50 000 1.300% Pinnacle West Capital Corp 15/06/2025                                 | 45 946           | 0,03              |
| 30 000 1.125% Pioneer Natural Resources Co 15/01/2026                               | 27 259           | 0,02              |
| 50 000 5.100% Pioneer Natural Resources Co 29/03/2026                               | 50 225           | 0,03              |
| 50 000 1.900% Pioneer Natural Resources Co 15/08/2030                               | 40 651           | 0,03              |
| 80 000 4.650% Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp 15/10/2025         | 79 254           | 0,05              |
| 50 000 4.500% Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp 15/12/2026         | 48 885           | 0,03              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 70 000 2.500% PNC Bank NA 27/08/2024                                    | 67 222           | 0,04              | 170 000 2.250% Prologis LP 15/04/2030                                   | 144 457          | 0,09              |
| 75 000 3.300% PNC Bank NA 30/10/2024                                    | 72 546           | 0,04              | 25 000 1.750% Prologis LP 01/07/2030                                    | 20 302           | 0,01              |
| 30 000 2.950% PNC Bank NA 23/02/2025                                    | 28 628           | 0,02              | 25 000 3.706% Prospect Capital Corp 22/01/2026                          | 22 128           | 0,01              |
| 30 000 3.875% PNC Bank NA 10/04/2025                                    | 28 994           | 0,02              | 25 000 3.625% PRUDENTIAL FDG ASIA PLC 24/03/2032                        | 22 740           | 0,01              |
| 20 000 3.250% PNC Bank NA 01/06/2025                                    | 19 100           | 0,01              | 30 000 1.500% Prudential Financial Inc 10/03/2026                       | 27 373           | 0,02              |
| 30 000 4.050% PNC Bank NA 26/07/2028                                    | 28 381           | 0,02              | 75 000 5.375% Prudential Financial Inc 15/05/2045                       | 69 922           | 0,04              |
| 90 000 2.700% PNC Bank NA 22/10/2029                                    | 77 301           | 0,05              | 30 000 4.500% Prudential Financial Inc 15/09/2047                       | 26 806           | 0,02              |
| 20 000 5.671% PNC Financial Services Group Inc 28/10/2025               | 20 004           | 0,01              | 30 000 5.125% Prudential Financial Inc 01/03/2052                       | 26 594           | 0,02              |
| 100 000 4.758% PNC Financial Services Group Inc 26/01/2027              | 98 776           | 0,06              | 50 000 3.700% Public Service Co of Colorado 15/06/2028                  | 48 380           | 0,03              |
| 10 000 3.150% PNC Financial Services Group Inc 19/05/2027               | 9 355            | 0,01              | 100 000 1.875% Public Service Co of Colorado 15/06/2031                 | 81 682           | 0,05              |
| 75 000 5.354% PNC Financial Services Group Inc 02/12/2028               | 75 450           | 0,05              | 15 000 2.200% Public Service Co of New Hampshire 15/06/2031             | 12 661           | 0,01              |
| 20 000 3.450% PNC Financial Services Group Inc 23/04/2029               | 18 559           | 0,01              | 10 000 3.200% Public Service Electric and Gas Co 15/05/2029             | 9 176            | 0,01              |
| 85 000 2.550% PNC Financial Services Group Inc 22/01/2030               | 72 505           | 0,04              | 185 000 4.900% Public Service Electric and Gas Co 15/12/2032            | 189 216          | 0,12              |
| 15 000 2.307% PNC Financial Services Group Inc 23/04/2032               | 12 332           | 0,01              | 15 000 4.650% Public Service Electric and Gas Co 15/03/2033             | 15 083           | 0,01              |
| 25 000 4.626% PNC Financial Services Group Inc 06/06/2033               | 23 169           | 0,01              | 200 000 0.800% Public Service Enterprise Group Inc 15/08/2025           | 182 940          | 0,11              |
| 125 000 6.037% PNC Financial Services Group Inc 28/10/2033              | 131 594          | 0,08              | 45 000 1.600% Public Service Enterprise Group Inc 15/08/2030            | 36 004           | 0,02              |
| 20 000 5.068% PNC Financial Services Group Inc 24/01/2034               | 19 746           | 0,01              | 25 000 2.450% Public Service Enterprise Group Inc 15/11/2031            | 20 706           | 0,01              |
| 85 000 1.200% PPG Industries Inc 15/03/2026                             | 76 656           | 0,05              | 85 000 0.875% Public Storage 15/02/2026                                 | 76 412           | 0,05              |
| 30 000 3.750% PPG Industries Inc 15/03/2028                             | 28 830           | 0,02              | 20 000 3.094% Public Storage 15/09/2027                                 | 18 836           | 0,01              |
| 25 000 2.800% Primerica Inc 19/11/2031                                  | 21 049           | 0,01              | 50 000 2.750% Public Storage 01/05/2029                                 | 46 511           | 0,03              |
| 130 000 3.100% Principal Financial Group Inc 15/11/2026                 | 124 242          | 0,08              | 81 000 4.100% Puget Energy Inc 15/06/2030                               | 74 940           | 0,05              |
| 110 000 0.550% Procter & Gamble Co 29/10/2025                           | 100 850          | 0,06              | 100 000 5.500% PulteGroup Inc 01/03/2026                                | 100 399          | 0,06              |
| 30 000 2.700% Procter & Gamble Co 02/02/2026                            | 29 045           | 0,02              | 80 000 4.375% Qorvo Inc 15/10/2029                                      | 73 759           | 0,05              |
| 60 000 1.000% Procter & Gamble Co 23/04/2026                            | 54 831           | 0,03              | 5 000 2.900% QUALCOMM Inc 20/05/2024                                    | 4 909            | 0,00              |
| 20 000 2.450% Procter & Gamble Co 03/11/2026                            | 18 955           | 0,01              | 50 000 3.450% QUALCOMM Inc 20/05/2025                                   | 49 054           | 0,03              |
| 20 000 2.800% Procter & Gamble Co 25/03/2027                            | 19 079           | 0,01              | 50 000 1.300% QUALCOMM Inc 20/05/2028                                   | 43 636           | 0,03              |
| 100 000 3.950% Procter & Gamble Co 26/01/2028                           | 100 444          | 0,06              | 130 000 4.250% QUALCOMM Inc 20/05/2032                                  | 130 086          | 0,08              |
| 50 000 3.000% Procter & Gamble Co 25/03/2030                            | 46 850           | 0,03              | 80 000 2.350% Quanta Services Inc 15/01/2032                            | 63 378           | 0,04              |
| 25 000 1.950% Procter & Gamble Co 23/04/2031                            | 21 624           | 0,01              | 80 000 3.450% Quest Diagnostics Inc 01/06/2026                          | 76 543           | 0,05              |
| 25 000 4.050% Procter & Gamble Co 26/01/2033                            | 25 145           | 0,02              | 30 000 6.625% Radian Group Inc 15/03/2025                               | 29 833           | 0,02              |
| 80 000 7.750% Progress Energy Inc 01/03/2031                            | 92 511           | 0,06              | 80 000 2.950% Ralph Lauren Corp 15/06/2030                              | 72 009           | 0,04              |
| 25 000 2.500% Progressive Corp 15/03/2027                               | 23 201           | 0,01              | 25 000 4.650% Raymond James Financial Inc 01/04/2030                    | 24 671           | 0,02              |
| 50 000 3.200% Progressive Corp 26/03/2030                               | 45 800           | 0,03              | 20 000 2.750% Rayonier LP 17/05/2031                                    | 16 512           | 0,01              |
| 165 000 3.000% Progressive Corp 15/03/2032                              | 147 525          | 0,09              |   |                  |                   |
| 15 000 2.125% Prologis LP 15/04/2027                                    | 13 681           | 0,01              |   |                  |                   |
| 10 000 4.000% Prologis LP 15/09/2028                                    | 9 732            | 0,01              |   |                  |                   |



## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 95 000 3.950% Raytheon Technologies Corp 16/08/2025                     | 93 789           | 0,06              | 55 000 7.125% Rio Tinto Finance USA Ltd 15/07/2028                      | 62 067           | 0,04              |
| 50 000 2.650% Raytheon Technologies Corp 01/11/2026                     | 47 028           | 0,03              | 10 000 2.875% Rockwell Automation Inc 01/03/2025                        | 9 711            | 0,01              |
| 130 000 4.125% Raytheon Technologies Corp 16/11/2028                    | 128 103          | 0,08              | 100 000 3.625% Rogers Communications Inc 15/12/2025                     | 96 784           | 0,06              |
| 50 000 2.250% Raytheon Technologies Corp 01/07/2030                     | 42 855           | 0,03              | 100 000 2.900% Rogers Communications Inc 15/11/2026                     | 93 598           | 0,06              |
| 25 000 1.900% Raytheon Technologies Corp 01/09/2031                     | 20 410           | 0,01              | 10 000 2.350% Roper Technologies Inc 15/09/2024                         | 9 624            | 0,01              |
| 90 000 2.375% Raytheon Technologies Corp 15/03/2032                     | 75 578           | 0,05              | 10 000 1.000% Roper Technologies Inc 15/09/2025                         | 9 142            | 0,01              |
| 60 000 5.150% Raytheon Technologies Corp 27/02/2033                     | 62 348           | 0,04              | 50 000 3.800% Roper Technologies Inc 15/12/2026                         | 48 407           | 0,03              |
| 106 000 4.875% Realty Income Corp 01/06/2026                            | 105 416          | 0,07              | 100 000 2.000% Roper Technologies Inc 30/06/2030                        | 82 467           | 0,05              |
| 50 000 3.950% Realty Income Corp 15/08/2027                             | 48 200           | 0,03              | 50 000 1.750% Roper Technologies Inc 15/02/2031                         | 39 955           | 0,02              |
| 25 000 3.650% Realty Income Corp 15/01/2028                             | 23 545           | 0,01              | 30 000 4.600% Ross Stores Inc 15/04/2025                                | 29 906           | 0,02              |
| 50 000 3.100% Realty Income Corp 15/12/2029                             | 44 747           | 0,03              | 50 000 0.875% Ross Stores Inc 15/04/2026                                | 44 593           | 0,03              |
| 50 000 4.850% Realty Income Corp 15/03/2030                             | 49 332           | 0,03              | 50 000 2.550% Royal Bank of Canada 16/07/2024                           | 48 388           | 0,03              |
| 65 000 5.625% Realty Income Corp 13/10/2032                             | 67 249           | 0,04              | 100 000 0.650% Royal Bank of Canada 29/07/2024                          | 94 454           | 0,06              |
| 100 000 2.850% Realty Income Corp 15/12/2032                            | 82 600           | 0,05              | 182 000 0.750% Royal Bank of Canada 07/10/2024                          | 170 700          | 0,11              |
| 100 000 6.300% Regal Rexnord Corp 15/02/2030                            | 100 461          | 0,06              | 100 000 5.660% Royal Bank of Canada 25/10/2024                          | 100 863          | 0,06              |
| 10 000 3.600% Regency Centers LP 01/02/2027                             | 9 494            | 0,01              | 40 000 2.250% Royal Bank of Canada 01/11/2024                           | 38 304           | 0,02              |
| 30 000 4.125% Regency Centers LP 15/03/2028                             | 28 463           | 0,02              | 35 000 1.150% Royal Bank of Canada 10/06/2025                           | 32 210           | 0,02              |
| 36 000 1.750% Regeneron Pharmaceuticals Inc 15/09/2030                  | 29 061           | 0,02              | 50 000 4.875% Royal Bank of Canada 12/01/2026                           | 50 096           | 0,03              |
| 30 000 3.950% Reinsurance Group of America Inc 15/09/2026               | 28 892           | 0,02              | 50 000 0.875% Royal Bank of Canada 20/01/2026                           | 45 009           | 0,03              |
| 15 000 3.900% Reinsurance Group of America Inc 15/05/2029               | 14 053           | 0,01              | 100 000 4.650% Royal Bank of Canada 27/01/2026                          | 98 550           | 0,06              |
| 90 000 1.300% Reliance Steel & Aluminum Co 15/08/2025                   | 82 688           | 0,05              | 25 000 1.200% Royal Bank of Canada 27/04/2026                           | 22 437           | 0,01              |
| 100 000 4.000% RELX Capital Inc 18/03/2029                              | 96 408           | 0,06              | 75 000 1.150% Royal Bank of Canada 14/07/2026                           | 67 341           | 0,04              |
| 55 000 3.600% RenaissanceRe Holdings Ltd 15/04/2029                     | 50 768           | 0,03              | 25 000 1.400% Royal Bank of Canada 02/11/2026                           | 22 169           | 0,01              |
| 10 000 2.500% Republic Services Inc 15/08/2024                          | 9 691            | 0,01              | 25 000 3.625% Royal Bank of Canada 04/05/2027                           | 23 955           | 0,01              |
| 25 000 3.200% Republic Services Inc 15/03/2025                          | 24 274           | 0,01              | 25 000 6.000% Royal Bank of Canada 01/11/2027                           | 26 142           | 0,02              |
| 50 000 0.875% Republic Services Inc 15/11/2025                          | 45 186           | 0,03              | 150 000 4.900% Royal Bank of Canada 12/01/2028                          | 150 111          | 0,09              |
| 30 000 3.950% Republic Services Inc 15/05/2028                          | 29 188           | 0,02              |   |                  |                   |
| 55 000 4.875% Republic Services Inc 01/04/2029                          | 55 695           | 0,03              |   |                  |                   |
| 25 000 1.450% Republic Services Inc 15/02/2031                          | 19 936           | 0,01              |   |                  |                   |
| 30 000 1.750% Republic Services Inc 15/02/2032                          | 24 059           | 0,01              |   |                  |                   |
| 50 000 2.125% Rexford Industrial Realty LP 01/12/2030                   | 40 223           | 0,02              |   |                  |                   |
| 10 000 4.450% Reynolds American Inc 12/06/2025                          | 9 822            | 0,01              |   |                  |                   |
| 50 000 5.000% RIO TINTO FIN USA PLC 09/03/2033                          | 51 580           | 0,03              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 25 000 2.300% Royal Bank of Canada 03/11/2031                           | 20 708           | 0,01              |
| 100 000 3.875% Royal Bank of Canada 04/05/2032                          | 93 162           | 0,06              |
| 50 000 1.750% Royalty Pharma PLC 02/09/2027                             | 43 340           | 0,03              |
| 110 000 2.200% Royalty Pharma PLC 02/09/2030                            | 89 751           | 0,06              |
| 20 000 3.922% Rush Obligated Group 15/11/2029                           | 18 576           | 0,01              |
| 70 000 2.500% Ryder System Inc 01/09/2024                               | 67 376           | 0,04              |
| 25 000 4.625% Ryder System Inc 01/06/2025                               | 24 668           | 0,02              |
| 30 000 2.850% Ryder System Inc 01/03/2027                               | 27 595           | 0,02              |
| 10 000 4.300% Ryder System Inc 15/06/2027                               | 9 718            | 0,01              |
| 25 000 5.650% Ryder System Inc 01/03/2028                               | 25 300           | 0,02              |
| 30 000 2.950% S&P Global Inc 22/01/2027                                 | 28 795           | 0,02              |
| 230 000 2.500% S&P Global Inc 01/12/2029                                | 204 369          | 0,13              |
| 40 000 5.875% Sabine Pass Liquefaction LLC 30/06/2026                   | 40 814           | 0,03              |
| 230 000 5.000% Sabine Pass Liquefaction LLC 15/03/2027                  | 229 160          | 0,14              |
| 230 000 4.200% Sabine Pass Liquefaction LLC 15/03/2028                  | 221 053          | 0,14              |
| 60 000 5.125% Sabra Health Care LP 15/08/2026                           | 56 212           | 0,03              |
| 20 000 0.625% Salesforce Inc 15/07/2024                                 | 19 007           | 0,01              |
| 50 000 3.700% Salesforce Inc 11/04/2028                                 | 49 109           | 0,03              |
| 140 000 1.950% Salesforce Inc 15/07/2031                                | 117 163          | 0,07              |
| 10 000 2.500% San Diego Gas & Electric Co 15/05/2026                    | 9 373            | 0,01              |
| 25 000 3.000% San Diego Gas & Electric Co 15/03/2032                    | 22 077           | 0,01              |
| 70 000 3.625% Sanofi 19/06/2028   | 68 402           | 0,04              |
| 50 000 3.450% Santander Holdings USA Inc 02/06/2025                     | 47 004           | 0,03              |
| 50 000 4.500% Santander Holdings USA Inc 17/07/2025                     | 47 757           | 0,03              |
| 50 000 4.400% Santander Holdings USA Inc 13/07/2027                     | 47 198           | 0,03              |
| 240 000 2.490% Santander Holdings USA Inc 06/01/2028                    | 207 598          | 0,13              |
| 30 000 1.532% Santander UK Group Holdings PLC 21/08/2026                | 26 795           | 0,02              |
| 30 000 6.833% Santander UK Group Holdings PLC 21/11/2026                | 30 408           | 0,02              |
| 50 000 1.673% Santander UK Group Holdings PLC 14/06/2027                | 43 556           | 0,03              |
| 100 000 2.469% Santander UK Group Holdings PLC 11/01/2028               | 87 907           | 0,05              |
| 30 000 3.823% Santander UK Group Holdings PLC 03/11/2028                | 27 452           | 0,02              |
| 100 000 2.896% Santander UK Group Holdings PLC 15/03/2032               | 81 104           | 0,05              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 2.875% Santander UK PLC 18/06/2024                               | 48 236           | 0,03              |
| 90 000 1.400% Schlumberger Finance Canada Ltd 17/09/2025                | 83 254           | 0,05              |
| 25 000 2.650% Schlumberger Investment SA 26/06/2030                     | 22 136           | 0,01              |
| 50 000 3.300% Sempra Energy 01/04/2025                                  | 48 432           | 0,03              |
| 50 000 3.250% Sempra Energy 15/06/2027                                  | 46 872           | 0,03              |
| 120 000 1.400% ServiceNow Inc 01/09/2030                                | 96 722           | 0,06              |
| 150 000 3.250% Shell International Finance BV 11/05/2025                | 146 625          | 0,09              |
| 175 000 2.875% Shell International Finance BV 10/05/2026                | 167 636          | 0,10              |
| 60 000 3.875% Shell International Finance BV 13/11/2028                 | 59 087           | 0,04              |
| 50 000 2.375% Shell International Finance BV 07/11/2029                 | 44 371           | 0,03              |
| 75 000 2.750% Shell International Finance BV 06/04/2030                 | 68 421           | 0,04              |
| 50 000 4.050% Sherwin-Williams Co 08/08/2024                            | 49 433           | 0,03              |
| 20 000 4.250% Sherwin-Williams Co 08/08/2025                            | 19 772           | 0,01              |
| 42 000 3.950% Sherwin-Williams Co 15/01/2026                            | 40 960           | 0,03              |
| 50 000 3.450% Sherwin-Williams Co 01/06/2027                            | 47 830           | 0,03              |
| 110 000 3.200% Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 23/09/2026    | 104 674          | 0,06              |
| 25 000 2.600% Sierra Pacific Power Co 01/05/2026                        | 23 581           | 0,01              |
| 180 000 3.500% Simon Property Group LP 01/09/2025                       | 173 727          | 0,11              |
| 65 000 3.300% Simon Property Group LP 15/01/2026                        | 62 227           | 0,04              |
| 25 000 1.375% Simon Property Group LP 15/01/2027                        | 21 996           | 0,01              |
| 38 000 3.375% Simon Property Group LP 15/06/2027                        | 35 697           | 0,02              |
| 10 000 2.650% Simon Property Group LP 15/07/2030                        | 8 425            | 0,01              |
| 175 000 2.200% Simon Property Group LP 01/02/2031                       | 140 962          | 0,09              |
| 20 000 2.250% Simon Property Group LP 15/01/2032                        | 15 659           | 0,01              |
| 50 000 3.625% SITE Centers Corp 01/02/2025                              | 47 347           | 0,03              |
| 51 000 4.250% SITE Centers Corp 01/02/2026                              | 47 650           | 0,03              |
| 15 000 1.800% Skyworks Solutions Inc 01/06/2026                         | 13 517           | 0,01              |
| 70 000 2.250% Sonoco Products Co 01/02/2027                             | 63 437           | 0,04              |
| 50 000 3.700% Southern California Edison Co 01/08/2025                  | 48 735           | 0,03              |
| 25 000 4.700% Southern California Edison Co 01/06/2027                  | 25 058           | 0,02              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 5.850% Southern California Edison Co 01/11/2027                  | 52 683           | 0,03              | 80 000 2.400% Steel Dynamics Inc 15/06/2025                             | 75 759           | 0,05              |
| 45 000 3.650% Southern California Edison Co 01/03/2028                  | 42 586           | 0,03              | 60 000 5.000% Steel Dynamics Inc 15/12/2026                             | 59 741           | 0,04              |
| 15 000 5.300% Southern California Edison Co 01/03/2028                  | 15 389           | 0,01              | 40 000 3.600% Stewart Information Services Corp 15/11/2031              | 31 476           | 0,02              |
| 60 000 4.200% Southern California Edison Co 01/03/2029                  | 58 145           | 0,04              | 125 000 1.150% Stryker Corp 15/06/2025                                  | 115 452          | 0,07              |
| 50 000 5.950% Southern California Edison Co 01/11/2032                  | 54 153           | 0,03              | 20 000 3.375% Stryker Corp 01/11/2025                                   | 19 288           | 0,01              |
| 25 000 3.150% Southern California Gas Co 15/09/2024                     | 24 422           | 0,02              | 20 000 3.500% Stryker Corp 15/03/2026                                   | 19 480           | 0,01              |
| 40 000 2.950% Southern California Gas Co 15/04/2027                     | 37 498           | 0,02              | 95 000 3.650% Stryker Corp 07/03/2028                                   | 91 436           | 0,06              |
| 50 000 2.550% Southern California Gas Co 01/02/2030                     | 43 652           | 0,03              | 50 000 3.400% Sumitomo Mitsui Banking Corp 11/07/2024                   | 49 003           | 0,03              |
| 25 000 3.250% Southern Co 01/07/2026                                    | 23 850           | 0,01              | 50 000 2.696% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 16/07/2024            | 48 275           | 0,03              |
| 50 000 5.113% Southern Co 01/08/2027                                    | 50 139           | 0,03              | 20 000 2.448% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 27/09/2024            | 19 164           | 0,01              |
| 115 000 5.700% Southern Co 15/10/2032                                   | 120 931          | 0,07              | 60 000 1.474% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 08/07/2025            | 55 004           | 0,03              |
| 40 000 3.750% Southern Co 15/09/2051                                    | 33 783           | 0,02              | 125 000 3.784% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 09/03/2026           | 121 849          | 0,08              |
| 15 000 3.875% Southern Copper Corp 23/04/2025                           | 14 568           | 0,01              | 100 000 2.632% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 14/07/2026           | 92 471           | 0,06              |
| 100 000 5.250% Southwest Airlines Co 04/05/2025                         | 100 320          | 0,06              | 200 000 1.402% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 17/09/2026           | 174 882          | 0,11              |
| 36 000 3.000% Southwest Airlines Co 15/11/2026                          | 33 687           | 0,02              | 30 000 3.446% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 11/01/2027            | 28 249           | 0,02              |
| 65 000 5.450% Southwest Gas Corp 23/03/2028                             | 65 744           | 0,04              | 150 000 3.364% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 12/07/2027           | 141 814          | 0,09              |
| 55 000 1.650% Southwestern Electric Power Co 15/03/2026                 | 50 216           | 0,03              | 175 000 3.352% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 18/10/2027           | 162 374          | 0,10              |
| 80 000 3.500% Spectra Energy Partners LP 15/03/2025                     | 77 575           | 0,05              | 250 000 5.520% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 13/01/2028           | 253 780          | 0,16              |
| 50 000 3.375% Spectra Energy Partners LP 15/10/2026                     | 47 507           | 0,03              | 50 000 1.902% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 17/09/2028            | 42 286           | 0,03              |
| 15 000 4.800% Spire Missouri Inc 15/02/2033                             | 14 968           | 0,01              | 100 000 2.472% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 14/01/2029           | 86 341           | 0,05              |
| 105 000 3.200% Spirit Realty LP 15/01/2027                              | 95 689           | 0,06              | 50 000 3.040% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 16/07/2029            | 44 224           | 0,03              |
| 25 000 2.100% Spirit Realty LP 15/03/2028                               | 21 023           | 0,01              | 100 000 2.750% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 15/01/2030           | 86 155           | 0,05              |
| 30 000 3.400% Spirit Realty LP 15/01/2030                               | 25 706           | 0,02              | 30 000 2.130% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 08/07/2030            | 24 417           | 0,02              |
| 40 000 3.823% SSM Health Care Corp 01/06/2027                           | 38 232           | 0,02              | 50 000 2.222% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 17/09/2031            | 39 889           | 0,02              |
| 30 000 3.310% Stanford Health Care 15/08/2030                           | 27 316           | 0,02              | 60 000 2.700% Sun Communities Operating LP 15/07/2031                   | 48 601           | 0,03              |
| 100 000 3.400% Stanley Black & Decker Inc 01/03/2026                    | 95 804           | 0,06              | 50 000 4.200% Sun Communities Operating LP 15/04/2032                   | 44 650           | 0,03              |
| 50 000 6.000% Stanley Black & Decker Inc 06/03/2028                     | 51 620           | 0,03              | 25 000 5.700% Sun Communities Operating LP 15/01/2033                   | 24 996           | 0,02              |
| 50 000 2.000% Starbucks Corp 12/03/2027                                 | 45 501           | 0,03              | 40 000 3.695% Sutter Health 15/08/2028                                  | 37 916           | 0,02              |
| 30 000 4.000% Starbucks Corp 15/11/2028                                 | 29 306           | 0,02              | 50 000 2.500% Suzano Austria GmbH 15/09/2028                            | 42 873           | 0,03              |
| 25 000 3.550% Starbucks Corp 15/08/2029                                 | 23 869           | 0,01              |   |                  |                   |
| 100 000 2.250% Starbucks Corp 12/03/2030                                | 86 061           | 0,05              |   |                  |                   |
| 70 000 3.000% Starbucks Corp 14/02/2032                                 | 62 058           | 0,04              |   |                  |                   |
| 70 000 4.800% Starbucks Corp 15/02/2033                                 | 70 496           | 0,04              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>                            |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>                      |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 6.000% Suzano Austria GmbH 15/01/2029  | 100 870          | 0,06              |
| 30 000 3.125% Suzano Austria GmbH 15/01/2032   | 24 608           | 0,02              |
| 50 000 5.625% Synchrony Bank 23/08/2027  | 45 949           | 0,03              |
| 15 000 4.250% Synchrony Financial 15/08/2024   | 14 015           | 0,01              |
| 30 000 4.500% Synchrony Financial 23/07/2025   | 27 235           | 0,02              |
| 10 000 3.700% Synchrony Financial 04/08/2026   | 8 748            | 0,01              |
| 100 000 3.950% Synchrony Financial 01/12/2027  | 84 828           | 0,05              |
| 50 000 5.150% Synchrony Financial 19/03/2029   | 44 010           | 0,03              |
| 90 000 2.875% Synchrony Financial 28/10/2031   | 64 157           | 0,04              |
| 50 000 3.300% Sysco Corp 15/07/2026  | 48 068           | 0,03              |
| 100 000 2.400% Sysco Corp 15/02/2030   | 87 203           | 0,05              |
| 40 000 5.950% Sysco Corp 01/04/2030  | 42 556           | 0,03              |
| 20 000 2.450% Sysco Corp 14/12/2031  | 16 672           | 0,01              |
| 60 000 5.000% Takeda Pharmaceutical Co Ltd 26/11/2028  | 60 672           | 0,04              |
| 50 000 3.550% Take-Two Interactive Software Inc 14/04/2025                                   | 48 669           | 0,03              |
| 25 000 3.700% Take-Two Interactive Software Inc 14/04/2027                                   | 24 173           | 0,01              |
| 25 000 2.400% Tampa Electric Co 15/03/2031   | 20 940           | 0,01              |
| 20 000 5.200% Targa Resources Corp 01/07/2027  | 19 826           | 0,01              |
| 80 000 6.875% Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 15/01/2029 | 81 870           | 0,05              |
| 90 000 4.875% Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 01/02/2031 | 84 840           | 0,05              |
| 60 000 4.000% Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 15/01/2032 | 52 470           | 0,03              |
| 30 000 3.500% Target Corp 01/07/2024   | 29 609           | 0,02              |
| 29 000 2.250% Target Corp 15/04/2025   | 27 865           | 0,02              |
| 25 000 2.500% Target Corp 15/04/2026   | 23 998           | 0,01              |
| 30 000 1.950% Target Corp 15/01/2027   | 27 742           | 0,02              |
| 100 000 2.350% Target Corp 15/02/2030  | 87 962           | 0,05              |
| 60 000 2.650% Target Corp 15/09/2030   | 53 185           | 0,03              |
| 25 000 4.500% Target Corp 15/09/2032   | 25 063           | 0,02              |
| 10 000 4.400% Target Corp 15/01/2033   | 9 938            | 0,01              |
| 80 000 7.125% TCI Communications Inc 15/02/2028  | 89 216           | 0,06              |
| 150 000 1.750% TD SYNnex Corp 09/08/2026   | 130 662          | 0,08              |
| 80 000 3.900% Teck Resources Ltd 15/07/2030  | 73 409           | 0,05              |
| 10 000 2.500% Teledyne FLIR LLC 01/08/2030   | 8 420            | 0,01              |
| 95 000 1.600% Teledyne Technologies Inc 01/04/2026   | 86 530           | 0,05              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 2.750% Teledyne Technologies Inc 01/04/2031                      | 42 689           | 0,03              |
| 100 000 8.250% Telefonica Europe BV 15/09/2030                          | 116 844          | 0,07              |
| 30 000 2.800% TELUS Corp 16/02/2027                                     | 28 139           | 0,02              |
| 50 000 3.400% TELUS Corp 13/05/2032                                     | 43 885           | 0,03              |
| 80 000 2.000% Tencent Music Entertainment Group 03/09/2030              | 63 498           | 0,04              |
| 30 000 1.375% Texas Instruments Inc 12/03/2025                          | 28 322           | 0,02              |
| 10 000 4.600% Texas Instruments Inc 15/02/2028                          | 10 214           | 0,01              |
| 15 000 2.250% Texas Instruments Inc 04/09/2029                          | 13 391           | 0,01              |
| 100 000 1.750% Texas Instruments Inc 04/05/2030                         | 84 782           | 0,05              |
| 35 000 3.650% Texas Instruments Inc 16/08/2032                          | 33 251           | 0,02              |
| 50 000 4.900% Texas Instruments Inc 14/03/2033                          | 52 085           | 0,03              |
| 25 000 4.000% Textron Inc 15/03/2026                                    | 24 581           | 0,02              |
| 30 000 3.650% Textron Inc 15/03/2027                                    | 28 687           | 0,02              |
| 50 000 1.215% Thermo Fisher Scientific Inc 18/10/2024                   | 47 490           | 0,03              |
| 50 000 4.800% Thermo Fisher Scientific Inc 21/11/2027                   | 51 258           | 0,03              |
| 10 000 1.750% Thermo Fisher Scientific Inc 15/10/2028                   | 8 790            | 0,01              |
| 30 000 2.600% Thermo Fisher Scientific Inc 01/10/2029                   | 27 083           | 0,02              |
| 50 000 2.000% Thermo Fisher Scientific Inc 15/10/2031                   | 41 575           | 0,03              |
| 25 000 4.950% Thermo Fisher Scientific Inc 21/11/2032                   | 25 938           | 0,02              |
| 15 000 4.500% Timken Co 15/12/2028                                      | 14 669           | 0,01              |
| 65 000 2.250% TJX Cos Inc 15/09/2026                                    | 61 053           | 0,04              |
| 110 000 3.500% T-Mobile USA Inc 15/04/2025                              | 106 955          | 0,07              |
| 150 000 2.250% T-Mobile USA Inc 15/02/2026                              | 139 791          | 0,09              |
| 25 000 2.625% T-Mobile USA Inc 15/04/2026                               | 23 399           | 0,01              |
| 170 000 3.750% T-Mobile USA Inc 15/04/2027                              | 163 474          | 0,10              |
| 50 000 2.050% T-Mobile USA Inc 15/02/2028                               | 44 412           | 0,03              |
| 65 000 4.950% T-Mobile USA Inc 15/03/2028                               | 65 616           | 0,04              |
| 200 000 2.625% T-Mobile USA Inc 15/02/2029                              | 176 396          | 0,11              |
| 150 000 3.375% T-Mobile USA Inc 15/04/2029                              | 136 746          | 0,08              |
| 230 000 3.875% T-Mobile USA Inc 15/04/2030                              | 215 715          | 0,13              |
| 100 000 2.550% T-Mobile USA Inc 15/02/2031                              | 84 712           | 0,05              |
| 50 000 2.875% T-Mobile USA Inc 15/02/2031                               | 43 121           | 0,03              |
| 60 000 2.250% T-Mobile USA Inc 15/11/2031                               | 49 115           | 0,03              |
| 50 000 2.700% T-Mobile USA Inc 15/03/2032                               | 42 109           | 0,03              |
| 50 000 5.200% T-Mobile USA Inc 15/01/2033                               | 50 887           | 0,03              |
| 70 000 4.875% Toll Brothers Finance Corp 15/03/2027                     | 68 062           | 0,04              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 65 000 2.650% Toronto-Dominion Bank 12/06/2024                          | 63 217           | 0,04              | 50 000 0.800% Toyota Motor Credit Corp 09/01/2026                       | 45 343           | 0,03              |
| 200 000 4.285% Toronto-Dominion Bank 13/09/2024                         | 197 698          | 0,12              | 20 000 1.125% Toyota Motor Credit Corp 18/06/2026                       | 18 038           | 0,01              |
| 50 000 3.766% Toronto-Dominion Bank 06/06/2025                          | 48 695           | 0,03              | 50 000 1.900% Toyota Motor Credit Corp 13/01/2027                       | 45 598           | 0,03              |
| 20 000 1.150% Toronto-Dominion Bank 12/06/2025                          | 18 424           | 0,01              | 25 000 3.050% Toyota Motor Credit Corp 22/03/2027                       | 23 733           | 0,01              |
| 10 000 0.750% Toronto-Dominion Bank 11/09/2025                          | 9 004            | 0,01              | 15 000 1.150% Toyota Motor Credit Corp 13/08/2027                       | 13 082           | 0,01              |
| 25 000 1.200% Toronto-Dominion Bank 03/06/2026                          | 22 269           | 0,01              | 25 000 4.550% Toyota Motor Credit Corp 20/09/2027                       | 25 119           | 0,02              |
| 125 000 1.250% Toronto-Dominion Bank 10/09/2026                         | 110 599          | 0,07              | 50 000 5.450% Toyota Motor Credit Corp 10/11/2027                       | 51 915           | 0,03              |
| 25 000 1.950% Toronto-Dominion Bank 12/01/2027                          | 22 458           | 0,01              | 50 000 3.050% Toyota Motor Credit Corp 11/01/2028                       | 47 219           | 0,03              |
| 120 000 2.800% Toronto-Dominion Bank 10/03/2027                         | 110 900          | 0,07              | 50 000 4.625% Toyota Motor Credit Corp 12/01/2028                       | 50 599           | 0,03              |
| 70 000 4.108% Toronto-Dominion Bank 08/06/2027                          | 67 815           | 0,04              | 40 000 3.650% Toyota Motor Credit Corp 08/01/2029                       | 38 534           | 0,02              |
| 160 000 5.156% Toronto-Dominion Bank 10/01/2028                         | 161 718          | 0,10              | 50 000 3.375% Toyota Motor Credit Corp 01/04/2030                       | 47 074           | 0,03              |
| 70 000 2.000% Toronto-Dominion Bank 10/09/2031                          | 56 340           | 0,03              | 80 000 1.900% Toyota Motor Credit Corp 12/09/2031                       | 65 912           | 0,04              |
| 73 000 3.625% Toronto-Dominion Bank 15/09/2031                          | 69 097           | 0,04              | 35 000 4.700% Toyota Motor Credit Corp 12/01/2033                       | 35 514           | 0,02              |
| 15 000 3.200% Toronto-Dominion Bank 10/03/2032                          | 13 194           | 0,01              | 90 000 3.750% Trane Technologies Global Holding Co Ltd 21/08/2028       | 87 143           | 0,05              |
| 125 000 4.456% Toronto-Dominion Bank 08/06/2032                         | 121 100          | 0,08              | 10 000 3.550% Trane Technologies Luxembourg Finance SA 01/11/2024       | 9 775            | 0,01              |
| 25 000 2.434% TotalEnergies Capital International SA 10/01/2025         | 24 193           | 0,01              | 40 000 3.500% Trane Technologies Luxembourg Finance SA 21/03/2026       | 38 807           | 0,02              |
| 100 000 3.455% TotalEnergies Capital International SA 19/02/2029        | 95 465           | 0,06              | 5 000 3.800% Trane Technologies Luxembourg Finance SA 21/03/2029        | 4 741            | 0,00              |
| 50 000 2.829% TotalEnergies Capital International SA 10/01/2030         | 45 596           | 0,03              | 100 000 1.000% TransCanada PipeLines Ltd 12/10/2024                     | 93 835           | 0,06              |
| 100 000 3.883% TotalEnergies Capital SA 11/10/2028                      | 98 531           | 0,06              | 10 000 4.875% TransCanada PipeLines Ltd 15/01/2026                      | 9 977            | 0,01              |
| 10 000 3.669% Toyota Motor Corp 20/07/2028                              | 9 733            | 0,01              | 90 000 2.500% TransCanada PipeLines Ltd 12/10/2031                      | 73 567           | 0,05              |
| 50 000 0.625% Toyota Motor Credit Corp 13/09/2024                       | 47 247           | 0,03              | 255 000 7.850% Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC 01/02/2026         | 273 138          | 0,17              |
| 185 000 4.400% Toyota Motor Credit Corp 20/09/2024                      | 184 643          | 0,11              | 40 000 4.900% Trimble Inc 15/06/2028                                    | 39 693           | 0,02              |
| 60 000 1.450% Toyota Motor Credit Corp 13/01/2025                       | 56 812           | 0,04              | 125 000 6.100% Trimble Inc 15/03/2033                                   | 126 071          | 0,08              |
| 40 000 1.800% Toyota Motor Credit Corp 13/02/2025                       | 38 086           | 0,02              | 20 000 1.500% Truist Bank 10/03/2025                                    | 18 425           | 0,01              |
| 160 000 3.000% Toyota Motor Credit Corp 01/04/2025                      | 155 002          | 0,10              | 30 000 3.625% Truist Bank 16/09/2025                                    | 28 629           | 0,02              |
| 100 000 5.400% Toyota Motor Credit Corp 10/11/2025                      | 102 611          | 0,06              | 20 000 3.300% Truist Bank 15/05/2026                                    | 18 459           | 0,01              |
|   |                  |                   | 180 000 2.636% Truist Bank 17/09/2029                                   | 168 665          | 0,10              |
|   |                  |                   | 200 000 2.250% Truist Bank 11/03/2030                                   | 164 160          | 0,10              |
|   |                  |                   | 25 000 2.500% Truist Financial Corp 01/08/2024                          | 23 944           | 0,01              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>           |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>     |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                                   |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 62 000 4.000% Truist Financial Corp 01/05/2025                              | 59 862           | 0,04              | 110 000 3.900% United Parcel Service Inc 01/04/2025                     | 108 679          | 0,07              |
| 200 000 4.260% Truist Financial Corp 28/07/2026                             | 192 696          | 0,12              | 100 000 2.400% United Parcel Service Inc 15/11/2026                     | 94 107           | 0,06              |
| 65 000 4.123% Truist Financial Corp 06/06/2028                              | 61 809           | 0,04              | 50 000 3.050% United Parcel Service Inc 15/11/2027                      | 47 604           | 0,03              |
| 40 000 4.873% Truist Financial Corp 26/01/2029                              | 38 932           | 0,02              | 30 000 2.500% United Parcel Service Inc 01/09/2029                      | 26 933           | 0,02              |
| 105 000 4.916% Truist Financial Corp 28/07/2033                             | 97 864           | 0,06              | 30 000 4.875% United Parcel Service Inc 03/03/2033                      | 30 749           | 0,02              |
| 30 000 3.875% TSMC Arizona Corp 22/04/2027                                  | 29 428           | 0,02              | 30 000 6.875% United Utilities PLC 15/08/2028                           | 32 902           | 0,02              |
| 30 000 4.125% TSMC Arizona Corp 22/04/2029                                  | 29 444           | 0,02              | 200 000 5.000% UnitedHealth Group Inc 15/10/2024                        | 201 576          | 0,13              |
| 80 000 2.500% TSMC Arizona Corp 25/10/2031                                  | 68 672           | 0,04              | 210 000 3.750% UnitedHealth Group Inc 15/07/2025                        | 207 671          | 0,13              |
| 60 000 4.250% TSMC Arizona Corp 22/04/2032                                  | 58 873           | 0,04              | 60 000 1.250% UnitedHealth Group Inc 15/01/2026                         | 55 135           | 0,03              |
| 25 000 1.500% Tucson Electric Power Co 01/08/2030                           | 19 994           | 0,01              | 55 000 3.450% UnitedHealth Group Inc 15/01/2027                         | 53 607           | 0,03              |
| 30 000 3.250% Tucson Electric Power Co 15/05/2032                           | 26 831           | 0,02              | 40 000 3.375% UnitedHealth Group Inc 15/04/2027                         | 38 511           | 0,02              |
| 100 000 3.700% Tyco Electronics Group SA 15/02/2026                         | 97 935           | 0,06              | 50 000 2.950% UnitedHealth Group Inc 15/10/2027                         | 47 267           | 0,03              |
| 80 000 3.950% Tyson Foods Inc 15/08/2024                                    | 78 862           | 0,05              | 70 000 5.250% UnitedHealth Group Inc 15/02/2028                         | 72 932           | 0,05              |
| 30 000 4.000% Tyson Foods Inc 01/03/2026                                    | 29 469           | 0,02              | 40 000 3.850% UnitedHealth Group Inc 15/06/2028                         | 39 096           | 0,02              |
| 10 000 4.350% Tyson Foods Inc 01/03/2029                                    | 9 709            | 0,01              | 30 000 3.875% UnitedHealth Group Inc 15/12/2028                         | 29 396           | 0,02              |
| 25 000 4.400% UDR Inc 26/01/2029  | 24 012           | 0,01              | 90 000 4.200% UnitedHealth Group Inc 15/05/2032                         | 88 077           | 0,05              |
| 25 000 3.000% UDR Inc 15/08/2031  | 21 406           | 0,01              | 100 000 4.500% UnitedHealth Group Inc 15/04/2033                        | 99 533           | 0,06              |
| 100 000 1.900% UDR Inc 15/03/2033   | 74 793           | 0,05              | 50 000 2.650% Universal Health Services Inc 15/10/2030                  | 40 082           | 0,02              |
| 90 000 2.600% Unilever Capital Corp 05/05/2024                              | 87 973           | 0,05              | 210 000 2.400% US Bancorp 30/07/2024                                    | 202 222          | 0,13              |
| 175 000 0.626% Unilever Capital Corp 12/08/2024                             | 165 284          | 0,10              | 25 000 3.100% US Bancorp 27/04/2026                                     | 23 200           | 0,01              |
| 30 000 3.375% Unilever Capital Corp 22/03/2025                              | 29 312           | 0,02              | 50 000 5.727% US Bancorp 21/10/2026                                     | 50 229           | 0,03              |
| 30 000 2.000% Unilever Capital Corp 28/07/2026                              | 28 054           | 0,02              | 90 000 3.150% US Bancorp 27/04/2027                                     | 84 244           | 0,05              |
| 50 000 3.500% Unilever Capital Corp 22/03/2028                              | 48 321           | 0,03              | 60 000 2.215% US Bancorp 27/01/2028                                     | 53 909           | 0,03              |
| 10 000 1.750% Unilever Capital Corp 12/08/2031                              | 8 222            | 0,00              | 50 000 4.548% US Bancorp 22/07/2028                                     | 48 671           | 0,03              |
| 30 000 3.500% Union Electric Co 15/03/2029                                  | 28 351           | 0,02              | 100 000 4.653% US Bancorp 01/02/2029                                    | 97 508           | 0,06              |
| 50 000 3.750% Union Pacific Corp 15/07/2025                                 | 49 271           | 0,03              | 155 000 5.850% US Bancorp 21/10/2033                                    | 161 961          | 0,10              |
| 40 000 3.250% Union Pacific Corp 15/08/2025                                 | 38 888           | 0,02              | 75 000 2.491% US Bancorp 03/11/2036                                     | 58 010           | 0,04              |
| 15 000 2.750% Union Pacific Corp 01/03/2026                                 | 14 374           | 0,01              | 100 000 3.950% Utah Acquisition Sub Inc 15/06/2026                      | 95 185           | 0,06              |
| 50 000 3.000% Union Pacific Corp 15/04/2027                                 | 47 751           | 0,03              | 40 000 3.750% Vale Overseas Ltd 08/07/2030                              | 35 919           | 0,02              |
| 30 000 3.950% Union Pacific Corp 10/09/2028                                 | 29 688           | 0,02              | 130 000 2.800% Valero Energy Corp 01/12/2031                            | 109 353          | 0,07              |
| 70 000 3.700% Union Pacific Corp 01/03/2029                                 | 67 987           | 0,04              |   |                  |                   |
| 100 000 2.400% Union Pacific Corp 05/02/2030                                | 88 132           | 0,05              |   |                  |                   |
| 50 000 2.800% Union Pacific Corp 14/02/2032                                 | 43 951           | 0,03              |   |                  |                   |
| 34 691 4.300% United Airlines 2013-1 Class A Pass Through Trust 15/02/2027  | 33 152           | 0,02              |   |                  |                   |
| 35 318 4.000% United Airlines 2014-1 Class A Pass Through Trust 11/10/2027  | 33 356           | 0,02              |   |                  |                   |
| 36 785 2.875% United Airlines 2016-2 Class AA Pass Through Trust 07/04/2030 | 32 504           | 0,02              |   |                  |                   |
| 26 536 2.700% United Airlines 2019-2 Class AA Pass Through Trust 01/11/2033 | 22 325           | 0,01              |   |                  |                   |
| 113 180 5.875% United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust 15/04/2029 | 112 438          | 0,07              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 10 000 3.000% Valley National Bancorp 15/06/2031                        | 8 517            | 0,01              | 10 000 1.400% VMware Inc 15/08/2026                                     | 8 843            | 0,01              |
| 50 000 3.750% Ventas Realty LP 01/05/2024                               | 48 939           | 0,03              | 50 000 4.650% VMware Inc 15/05/2027                                     | 49 342           | 0,03              |
| 50 000 4.125% Ventas Realty LP 15/01/2026                               | 48 536           | 0,03              | 100 000 3.900% VMware Inc 21/08/2027                                    | 95 697           | 0,06              |
| 80 000 4.750% Ventas Realty LP 15/11/2030                               | 77 253           | 0,05              | 15 000 1.800% VMware Inc 15/08/2028                                     | 12 667           | 0,01              |
| 278 000 3.500% Verizon Communications Inc 01/11/2024                    | 272 957          | 0,17              | 230 000 4.700% VMware Inc 15/05/2030                                    | 222 969          | 0,14              |
| 75 000 3.376% Verizon Communications Inc 15/02/2025                     | 73 539           | 0,05              | 160 000 4.125% Vodafone Group PLC 30/05/2025                            | 158 208          | 0,10              |
| 102 000 0.850% Verizon Communications Inc 20/11/2025                    | 92 896           | 0,06              | 100 000 2.950% Vontier Corp 01/04/2031                                  | 79 593           | 0,05              |
| 20 000 1.450% Verizon Communications Inc 20/03/2026                     | 18 406           | 0,01              | 50 000 5.800% Vulcan Materials Co 01/03/2026                            | 50 482           | 0,03              |
| 50 000 2.625% Verizon Communications Inc 15/08/2026                     | 47 272           | 0,03              | 50 000 3.900% Vulcan Materials Co 01/04/2027                            | 48 631           | 0,03              |
| 40 000 4.125% Verizon Communications Inc 16/03/2027                     | 39 675           | 0,02              | 40 000 3.800% Walgreens Boots Alliance Inc 18/11/2024                   | 39 268           | 0,02              |
| 50 000 3.000% Verizon Communications Inc 22/03/2027                     | 47 518           | 0,03              | 30 000 3.200% Walgreens Boots Alliance Inc 15/04/2030                   | 26 361           | 0,02              |
| 100 000 2.100% Verizon Communications Inc 22/03/2028                    | 89 099           | 0,06              | 130 000 2.850% Walmart Inc 08/07/2024                                   | 127 241          | 0,08              |
| 85 000 4.329% Verizon Communications Inc 21/09/2028                     | 83 913           | 0,05              | 30 000 3.550% Walmart Inc 26/06/2025                                    | 29 705           | 0,02              |
| 50 000 4.016% Verizon Communications Inc 03/12/2029                     | 47 890           | 0,03              | 150 000 3.900% Walmart Inc 09/09/2025                                   | 149 644          | 0,09              |
| 50 000 1.750% Verizon Communications Inc 20/01/2031                     | 40 262           | 0,02              | 15 000 1.050% Walmart Inc 17/09/2026                                    | 13 523           | 0,01              |
| 305 000 2.550% Verizon Communications Inc 21/03/2031                    | 259 845          | 0,16              | 60 000 3.950% Walmart Inc 09/09/2027                                    | 59 980           | 0,04              |
| 320 000 2.355% Verizon Communications Inc 15/03/2032                    | 262 544          | 0,16              | 70 000 3.700% Walmart Inc 26/06/2028                                    | 69 343           | 0,04              |
| 25 000 2.950% VF Corp 23/04/2030  | 21 047           | 0,01              | 15 000 1.500% Walmart Inc 22/09/2028                                    | 13 165           | 0,01              |
| 100 000 1.650% Viatris Inc 22/06/2025                                   | 91 864           | 0,06              | 20 000 3.250% Walmart Inc 08/07/2029                                    | 19 085           | 0,01              |
| 70 000 2.700% Viatris Inc 22/06/2030                                    | 57 049           | 0,04              | 100 000 4.150% Walmart Inc 09/09/2032                                   | 100 749          | 0,06              |
| 80 000 4.750% VICI Properties LP 15/02/2028                             | 76 550           | 0,05              | 265 000 3.700% Walt Disney Co 15/09/2024                                | 261 563          | 0,16              |
| 90 000 4.950% VICI Properties LP 15/02/2030                             | 85 054           | 0,05              | 50 000 3.350% Walt Disney Co 24/03/2025                                 | 49 121           | 0,03              |
| 20 000 5.125% VICI Properties LP 15/05/2032                             | 18 906           | 0,01              | 45 000 3.700% Walt Disney Co 23/03/2027                                 | 44 105           | 0,03              |
| 100 000 3.500% Virginia Electric and Power Co 15/03/2027                | 96 204           | 0,06              | 188 000 2.200% Walt Disney Co 13/01/2028                                | 172 654          | 0,11              |
| 30 000 3.750% Virginia Electric and Power Co 15/05/2027                 | 29 142           | 0,02              | 20 000 2.000% Walt Disney Co 01/09/2029                                 | 17 348           | 0,01              |
| 110 000 2.875% Virginia Electric and Power Co 15/07/2029                | 99 663           | 0,06              | 50 000 3.800% Walt Disney Co 22/03/2030                                 | 48 205           | 0,03              |
| 50 000 5.000% Virginia Electric and Power Co 01/04/2033                 | 50 422           | 0,03              | 50 000 2.650% Walt Disney Co 13/01/2031                                 | 44 128           | 0,03              |
| 127 000 3.150% Visa Inc 14/12/2025                                      | 123 347          | 0,08              | 150 000 3.755% Warnermedia Holdings Inc 15/03/2027                      | 141 312          | 0,09              |
| 100 000 1.900% Visa Inc 15/04/2027                                      | 92 247           | 0,06              | 175 000 4.279% Warnermedia Holdings Inc 15/03/2032                      | 156 149          | 0,10              |
| 15 000 2.050% Visa Inc 15/04/2030                                       | 13 095           | 0,01              | 50 000 3.500% Waste Connections Inc 01/05/2029                          | 46 631           | 0,03              |
| 50 000 1.100% Visa Inc 15/02/2031                                       | 39 924           | 0,02              | 50 000 2.600% Waste Connections Inc 01/02/2030                          | 44 040           | 0,03              |
|   |                  |                   | 50 000 4.200% Waste Connections Inc 15/01/2033                          | 47 921           | 0,03              |
|   |                  |                   | 30 000 1.500% Waste Management Inc 15/03/2031                           | 23 921           | 0,01              |
|   |                  |                   | 20 000 4.150% Waste Management Inc 15/04/2032                           | 19 372           | 0,01              |
|   |                  |                   | 200 000 4.625% Waste Management Inc 15/02/2033                          | 200 562          | 0,12              |
|   |                  |                   | 20 000 5.150% WEC Energy Group Inc 01/10/2027                           | 20 375           | 0,01              |

## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 15 000 4.750% WEC Energy Group Inc 15/01/2028                           | 15 003           | 0,01              |
| 30 000 2.200% WEC Energy Group Inc 15/12/2028                           | 26 147           | 0,02              |
| 50 000 3.000% Wells Fargo & Co 19/02/2025                               | 48 142           | 0,03              |
| 45 000 0.805% Wells Fargo & Co 19/05/2025                               | 42 750           | 0,03              |
| 50 000 6.000% Wells Fargo & Co 28/10/2025                               | 50 059           | 0,03              |
| 225 000 2.406% Wells Fargo & Co 30/10/2025                              | 213 982          | 0,13              |
| 90 000 2.164% Wells Fargo & Co 11/02/2026                               | 84 778           | 0,05              |
| 35 000 3.000% Wells Fargo & Co 22/04/2026                               | 33 075           | 0,02              |
| 100 000 3.908% Wells Fargo & Co 25/04/2026                              | 96 962           | 0,06              |
| 290 000 2.188% Wells Fargo & Co 30/04/2026                              | 272 110          | 0,17              |
| 400 000 3.000% Wells Fargo & Co 23/10/2026                              | 373 984          | 0,23              |
| 40 000 3.196% Wells Fargo & Co 17/06/2027                               | 37 648           | 0,02              |
| 290 000 4.300% Wells Fargo & Co 22/07/2027                              | 281 213          | 0,17              |
| 55 000 3.526% Wells Fargo & Co 24/03/2028                               | 51 890           | 0,03              |
| 82 000 3.584% Wells Fargo & Co 22/05/2028                               | 77 225           | 0,05              |
| 100 000 2.393% Wells Fargo & Co 02/06/2028                              | 89 920           | 0,06              |
| 200 000 4.808% Wells Fargo & Co 25/07/2028                              | 197 554          | 0,12              |
| 300 000 4.150% Wells Fargo & Co 24/01/2029                              | 287 007          | 0,18              |
| 90 000 2.879% Wells Fargo & Co 30/10/2030                               | 78 102           | 0,05              |
| 90 000 2.572% Wells Fargo & Co 11/02/2031                               | 76 361           | 0,05              |
| 30 000 4.478% Wells Fargo & Co 04/04/2031                               | 28 718           | 0,02              |
| 130 000 3.350% Wells Fargo & Co 02/03/2033                              | 112 667          | 0,07              |
| 115 000 4.897% Wells Fargo & Co 25/07/2033                              | 112 170          | 0,07              |
| 245 000 4.000% Welltower OP LLC 01/06/2025                              | 237 510          | 0,15              |
| 15 000 4.250% Welltower OP LLC 15/04/2028                               | 14 346           | 0,01              |
| 30 000 4.125% Welltower OP LLC 15/03/2029                               | 27 971           | 0,02              |
| 70 000 2.750% Welltower OP LLC 15/01/2031                               | 58 040           | 0,04              |
| 50 000 3.100% Western Digital Corp 01/02/2032                           | 37 762           | 0,02              |
| 200 000 4.550% Western Midstream Operating LP 01/02/2030                | 181 912          | 0,11              |
| 10 000 6.150% Western Midstream Operating LP 01/04/2033                 | 10 159           | 0,01              |
| 15 000 2.850% Western Union Co 10/01/2025                               | 14 317           | 0,01              |
| 20 000 3.450% Westinghouse Air Brake Technologies Corp 15/11/2026       | 18 798           | 0,01              |
| 100 000 4.950% Westinghouse Air Brake Technologies Corp 15/09/2028      | 98 211           | 0,06              |
| 100 000 3.600% Westlake Corp 15/08/2026                                 | 95 589           | 0,06              |
| 20 000 3.735% Westpac Banking Corp 26/08/2025                           | 19 565           | 0,01              |
| 60 000 2.850% Westpac Banking Corp 13/05/2026                           | 56 866           | 0,04              |
| 170 000 1.150% Westpac Banking Corp 03/06/2026                          | 152 476          | 0,09              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 2.700% Westpac Banking Corp 19/08/2026                           | 46 963           | 0,03              |
| 20 000 4.043% Westpac Banking Corp 26/08/2027                           | 19 624           | 0,01              |
| 25 000 5.457% Westpac Banking Corp 18/11/2027                           | 25 987           | 0,02              |
| 100 000 2.650% Westpac Banking Corp 16/01/2030                          | 89 166           | 0,06              |
| 196 000 2.894% Westpac Banking Corp 04/02/2030                          | 184 042          | 0,11              |
| 150 000 2.150% Westpac Banking Corp 03/06/2031                          | 126 637          | 0,08              |
| 110 000 4.322% Westpac Banking Corp 23/11/2031                          | 104 422          | 0,06              |
| 40 000 4.110% Westpac Banking Corp 24/07/2034                           | 35 770           | 0,02              |
| 40 000 2.668% Westpac Banking Corp 15/11/2035                           | 31 206           | 0,02              |
| 70 000 4.000% Weyerhaeuser Co 15/04/2030                                | 65 527           | 0,04              |
| 65 000 4.700% Whirlpool Corp 14/05/2032                                 | 62 189           | 0,04              |
| 30 000 5.400% Williams Cos Inc 02/03/2026                               | 30 600           | 0,02              |
| 110 000 3.750% Williams Cos Inc 15/06/2027                              | 105 612          | 0,07              |
| 100 000 2.600% Williams Cos Inc 15/03/2031                              | 83 912           | 0,05              |
| 85 000 4.650% Williams Cos Inc 15/08/2032                               | 81 891           | 0,05              |
| 40 000 3.600% Willis North America Inc 15/05/2024                       | 38 990           | 0,02              |
| 60 000 2.950% Willis North America Inc 15/09/2029                       | 52 585           | 0,03              |
| 100 000 4.750% Wisconsin Electric Power Co 30/09/2032                   | 100 545          | 0,06              |
| 25 000 3.950% Wisconsin Power and Light Co 01/09/2032                   | 23 555           | 0,01              |
| 20 000 4.950% Wisconsin Power and Light Co 01/04/2033                   | 20 151           | 0,01              |
| 100 000 3.500% Workday Inc 01/04/2027                                   | 95 733           | 0,06              |
| 40 000 3.800% Workday Inc 01/04/2032                                    | 36 617           | 0,02              |
| 20 000 4.600% WP Carey Inc 01/04/2024                                   | 19 577           | 0,01              |
| 20 000 3.750% WPP Finance 2010 19/09/2024                               | 19 498           | 0,01              |
| 100 000 4.650% WRKCo Inc 15/03/2026                                     | 98 989           | 0,06              |
| 20 000 3.375% WRKCo Inc 15/09/2027                                      | 18 660           | 0,01              |
| 50 000 4.000% WRKCo Inc 15/03/2028                                      | 47 685           | 0,03              |
| 50 000 3.900% WRKCo Inc 01/06/2028                                      | 47 560           | 0,03              |
| 30 000 3.300% Xcel Energy Inc 01/06/2025                                | 29 024           | 0,02              |
| 50 000 3.350% Xcel Energy Inc 01/12/2026                                | 47 709           | 0,03              |
| 75 000 1.750% Xcel Energy Inc 15/03/2027                                | 67 215           | 0,04              |
| 25 000 2.600% Xcel Energy Inc 01/12/2029                                | 21 854           | 0,01              |
| 25 000 2.350% Xcel Energy Inc 15/11/2031                                | 20 449           | 0,01              |
| 10 000 2.950% Xilinx Inc 01/06/2024                                     | 9 779            | 0,01              |



## SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|---|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b>       |                    |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,94 % (mars 2022 : 98,73 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Dollar américain – 98,94 % (suite)</b>                               |                    |                   |
| 50 000 2.375% Xilinx Inc 01/06/2030                                     | 43 554             | 0,03              |
| 50 000 1.482% Yale University 15/04/2030                                | 41 854             | 0,03              |
| 50 000 1.450% Zimmer Biomet Holdings Inc 22/11/2024                     | 47 268             | 0,03              |
| 47 000 3.550% Zimmer Biomet Holdings Inc 01/04/2025                     | 45 580             | 0,03              |
| 50 000 3.050% Zimmer Biomet Holdings Inc 15/01/2026                     | 47 953             | 0,03              |
| 100 000 3.000% Zoetis Inc 12/09/2027                                    | 94 716             | 0,06              |
| 20 000 3.900% Zoetis Inc 20/08/2028                                     | 19 453             | 0,01              |
| 25 000 2.000% Zoetis Inc 15/05/2030                                     | 21 031             | 0,01              |
| 25 000 5.600% Zoetis Inc 16/11/2032                                     | 26 671             | 0,02              |
| <b>Total des obligations d'entreprise</b>                               | <b>159 368 583</b> | <b>98,94</b>      |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>                                     | <b>159 368 583</b> | <b>98,94</b>      |

|   | Juste valeur USD   | % du Comp.    |
|---|--------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | <b>159 368 583</b> | <b>98,94</b>  |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,54 %)</b>                               | <b>1 115 843</b>   | <b>0,69</b>   |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : 0,73 %)</b>                                      | <b>589 032</b>     | <b>0,37</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>161 073 458</b> | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

| Analyse du total des actifs (non auditée)  | % du total des actifs |
|--|-----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs            | 83,60                 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé                        | 6,56                  |
| Autres valeurs mobilières du type mentionné dans le Règlement 68(1)(a), (b) et (c) | 6,64                  |
| Autres actifs  | 3,20                  |
| <b>Total des actifs</b>  | <b>100,00</b>         |

## SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |             |
|--|-------|----------------------|----------------------|-------------|
| <b>Actifs circulants</b>   |       |                      |                      |             |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                         |       |                      |                      |             |
|  | 1(e)  |                      |                      |             |
| Valeurs mobilières   |       | 2 552 940 405        | 2 953 169 072        |             |
| Instruments financiers dérivés   |       | 6 323 103            | 2 398 221            |             |
|  |       | <b>2 559 263 508</b> | <b>2 955 567 293</b> |             |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie  | 1(f)  | 27 599 459           | 48 387 621           |             |
| Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties à des instruments financiers ouverts | 1(g)  | -                    | 4 600 000            |             |
| Créances :   |       |                      |                      |             |
| Dividendes à recevoir  |       | 358                  | -                    |             |
| Intérêts à recevoir  |       | 36 494 323           | 41 699 066           |             |
| Produits divers à recevoir   |       | -                    | 295                  |             |
| À recevoir sur cessions d'investissements  |       | 30 814 627           | 23 081 689           |             |
| <b>Total des actifs circulants</b>   |       | <b>2 654 172 275</b> | <b>3 073 335 964</b> |             |
| <b>Passifs circulants</b>  |       |                      |                      |             |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                        |       |                      |                      |             |
|  | 1(e)  |                      |                      |             |
| Instruments financiers dérivés   |       | (1 086 087)          | (7 101 054)          |             |
| Découverts bancaires   | 1(f)  | (3 090 446)          | -                    |             |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :   |       |                      |                      |             |
| Charges à payer  |       | (1 228 247)          | (1 455 418)          |             |
| Produits divers à payer  |       | (79 616)             | -                    |             |
| À payer sur achats d'investissements   |       | (37 853 773)         | (33 387 538)         |             |
| <b>Total des passifs circulants</b>  |       | <b>(43 338 169)</b>  | <b>(41 944 010)</b>  |             |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>              |       | <b>2 610 834 106</b> | <b>3 031 391 954</b> |             |
|  |       | <b>2023</b>          | <b>2022</b>          | <b>2021</b> |
| Valeur liquidative par action  |       |                      |                      |             |
| Catégorie couverte en EUR  | 5     | 25,40 EUR            | 26,90 EUR            | 29,03 EUR   |
| Catégorie non couverte en USD (Acc)  | 5     | 29,65 USD            | 30,31 USD            | 32,33 USD   |
| Catégorie non couverte en USD (Dist)   | 5     | 56,88 USD            | 60,44 USD            | 67,08 USD   |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|---|-------|----------------------|----------------------|
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 131 089 566          | 146 660 344          |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 9     | (239 256 349)        | (357 906 233)        |
| Produits divers   |       | 153 295              | -                    |
| <b>Total des charges d'investissement</b>   |       | <b>(108 013 488)</b> | <b>(211 245 889)</b> |
| Charges opérationnelles   | 3     | (14 989 387)         | (18 480 754)         |
| <b>Perte nette pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(123 002 875)</b> | <b>(229 726 643)</b> |
| <b>Charges financières</b>  |       |                      |                      |
| Charges d'intérêts  |       | -                    | (32 927)             |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables   | 7     | (89 550 225)         | (109 763 284)        |
| <b>Perte pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(212 553 100)</b> | <b>(339 522 854)</b> |
| Impôt sur les plus-values de capital  | 2     | (589 647)            | (1 775 008)          |
| Retenue à la source sur produits d'investissement   | 2     | (4 358 594)          | (5 422 975)          |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(217 501 341)</b> | <b>(346 720 837)</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|---|----------------------|----------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier               | 3 031 391 954        | 3 508 742 471        |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(217 501 341)</b> | <b>(346 720 837)</b> |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                      |                      |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 1 161 875 374        | 1 444 868 941        |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (1 364 931 881)      | (1 575 498 621)      |
| Diminution des actifs nets résultant d'opérations sur actions   | (203 056 507)        | (130 629 680)        |
| <b>Diminution totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                   | <b>(420 557 848)</b> | <b>(477 350 517)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>        | <b>2 610 834 106</b> | <b>3 031 391 954</b> |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|---|-------|----------------------|----------------------|
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(217 501 341)</b> | <b>(346 720 837)</b> |
| <b>Ajustement pour :</b>  |       |                      |                      |
| Variation de la trésorerie détenue par/à payer au courtier  |       | 4 600 000            | (3 850 000)          |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  |       | 396 961 964          | 631 252 776          |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés   |       | (9 939 849)          | (3 736 087)          |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   |       | <b>174 120 774</b>   | <b>276 945 852</b>   |
| Variation des montants à recevoir   |       | 5 204 680            | 5 457 519            |
| Variation des montants à payer  |       | (147 555)            | (334 532)            |
| <b>Entrées de trésorerie sur opérations</b>   |       | <b>5 057 125</b>     | <b>5 122 987</b>     |
| <b>Entrées de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  |       | <b>179 177 899</b>   | <b>282 068 839</b>   |
| <b>Activités de financement</b>   |       |                      |                      |
| Produits des souscriptions  | 5     | 1 161 875 374        | 1 444 868 941        |
| Paiements sur rachats   | 5     | (1 364 931 881)      | (1 742 350 725)      |
| <b>Trésorerie nette utilisée sur activités de financement</b>   |       | <b>(203 056 507)</b> | <b>(297 481 784)</b> |
| <b>Diminution nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>   |       | <b>(23 878 608)</b>  | <b>(15 412 945)</b>  |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  |       | 48 387 621           | 63 800 566           |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   |       | <b>24 509 013</b>    | <b>48 387 621</b>    |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie – État de la situation financière   |       | 27 599 459           | 48 387 621           |
| Découverts bancaires – État de la situation financière  |       | (3 090 446)          | -                    |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie – État des flux de trésorerie</b>  |       | <b>24 509 013</b>    | <b>48 387 621</b>    |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |       |                      |                      |
| Impôts payés  |       | (4 948 241)          | (7 197 983)          |
| Intérêts reçus  |       | 132 423 228          | 154 339 637          |
| Intérêts payés  |       | -                    | (32 927)             |
| Distributions payées  |       | (89 550 225)         | (109 763 284)        |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                                 | Juste valeur USD   | % des actifs nets  | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD                                 | % des actifs nets                                |                   |             |
|--|--|--------------------|---|--|--|-------------------|-------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,78 % (mars 2022 : 97,42 %)</b>    |  |                    | <b>Valeurs mobilières – 97,78 % (mars 2022 : 97,42 %) (suite)</b> |  |  |                   |             |
| <b>Obligations d'entreprise – Néant (mars 2022 : 0,10 %)</b> |  |                    | <b>Obligations d'État – 97,78 % (mars 2022 : 97,32 %) (suite)</b> |  |  |                   |             |
| <b>Obligations d'État – 97,78 % (mars 2022 : 97,32 %)</b>    |  |                    | <b>Peso colombien – 2,34 %</b>                                    |  |  |                   |             |
| <b>Réal brésilien – 8,56 %</b>                               |  |                    | 34 460 000 000  | 6.250% Colombian TES 26/11/2025                  | 6 622 181  | 0,25              |             |
| 135 000 000  | 0.000% Brazil Letras do Tesouro Nacional 01/07/2023              | 25 814 881         | 0,99  | 48 800 000 000                                   | 7.500% Colombian TES 26/08/2026                  | 9 428 593         | 0,36        |
| 117 400 000  | 0.000% Brazil Letras do Tesouro Nacional 01/01/2024              | 21 128 411         | 0,81  | 21 950 000 000                                   | 5.750% Colombian TES 03/11/2027                  | 3 812 799         | 0,15        |
| 217 000 000  | 0.000% Brazil Letras do Tesouro Nacional 01/07/2024              | 37 027 705         | 1,42  | 47 150 000 000                                   | 6.000% Colombian TES 28/04/2028                  | 8 118 591         | 0,31        |
| 138 000 000  | 0.000% Brazil Letras do Tesouro Nacional 01/01/2025              | 22 321 420         | 0,85  | 28 300 000 000                                   | 7.750% Colombian TES 18/09/2030                  | 4 946 674         | 0,19        |
| 149 500 000  | 0.000% Brazil Letras do Tesouro Nacional 01/07/2025              | 22 912 473         | 0,88  | 37 800 000 000                                   | 7.000% Colombian TES 26/03/2031                  | 6 230 606         | 0,24        |
| 101 460 000  | 0.000% Brazil Letras do Tesouro Nacional 01/01/2026              | 14 644 738         | 0,56  | 38 050 000 000                                   | 7.000% Colombian TES 30/06/2032                  | 6 053 378         | 0,23        |
| 30 850 000   | 10.000% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/2025      | 5 903 742          | 0,23  | 38 300 000 000                                   | 7.250% Colombian TES 18/10/2034                  | 5 859 206         | 0,23        |
| 150 900 000  | 10.000% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/2027      | 27 968 695         | 1,07  | 21 300 000 000                                   | 6.250% Colombian TES 09/07/2036                  | 2 896 269         | 0,11        |
| 112 600 000  | 10.000% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/2029      | 20 103 702         | 0,77  | 23 100 000 000                                   | 9.250% Colombian TES 28/05/2042                  | 3 856 486         | 0,15        |
| 62 000 000   | 10.000% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/2031      | 10 699 058         | 0,41  | 24 500 000 000                                   | 7.250% Colombian TES 26/10/2050                  | 3 172 168         | 0,12        |
| 77 000 000   | 10.000% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/2033      | 12 932 021         | 0,49  |  |  | <b>60 996 951</b> | <b>2,34</b> |
| 3 650 000  | 8.500% Brazilian Government International Bond 05/01/2024        | 696 489            | 0,03  | <b>Couronne tchèque – 3,88 %</b>                 |  |                   |             |
| 6 850 000  | 10.250% Brazilian Government International Bond 10/01/2028       | 1 276 712          | 0,05  | 27 500 000                                       | 0.000% Czech Republic Government Bond 12/12/2024 | 1 160 213         | 0,05        |
|  |  | <b>223 430 047</b> | <b>8,56</b>   | 197 100 000                                      | 1.250% Czech Republic Government Bond 14/02/2025 | 8 452 837         | 0,32        |
| <b>Peso chilien – 1,62 %</b>                                 |  |                    | 163 300 000   | 2.400% Czech Republic Government Bond 17/09/2025 | 7 067 298  | 0,27              |             |
| 6 155 000 000  | 2.500% Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 01/03/2025 | 7 242 115          | 0,28  | 46 200 000                                       | 6.000% Czech Republic Government Bond 26/02/2026 | 2 189 684         | 0,08        |
| 6 650 000 000  | 4.500% Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 01/03/2026 | 8 039 282          | 0,31  | 255 300 000                                      | 1.000% Czech Republic Government Bond 26/06/2026 | 10 424 001        | 0,40        |
| 1 350 000 000  | 2.300% Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 01/10/2028 | 1 452 418          | 0,05  | 216 770 000                                      | 0.250% Czech Republic Government Bond 10/02/2027 | 8 409 118         | 0,32        |
| 2 350 000 000  | 5.000% Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 01/10/2028 | 2 893 769          | 0,11  | 155 110 000                                      | 2.500% Czech Republic Government Bond 25/08/2028 | 6 397 518         | 0,25        |
| 4 180 000 000  | 4.700% Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 01/09/2030 | 5 091 436          | 0,19  | 90 000 000                                       | 5.500% Czech Republic Government Bond 12/12/2028 | 4 311 140         | 0,17        |
| 800 000 000  | 2.800% Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 01/10/2033 | 827 989            | 0,03  | 145 800 000                                      | 2.750% Czech Republic Government Bond 23/07/2029 | 6 015 484         | 0,23        |
| 1 350 000 000  | 7.000% Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 01/05/2034 | 1 976 548          | 0,08  | 164 000 000                                      | 0.050% Czech Republic Government Bond 29/11/2029 | 5 589 110         | 0,21        |
| 4 710 000 000  | 5.000% Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 01/03/2035 | 5 910 719          | 0,23  | 194 900 000                                      | 0.950% Czech Republic Government Bond 15/05/2030 | 6 996 283         | 0,27        |
| 4 785 000 000  | 6.000% Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 01/01/2043 | 6 728 269          | 0,26  | 35 000 000                                       | 5.000% Czech Republic Government Bond 30/09/2030 | 1 649 230         | 0,06        |
| 1 650 000 000  | 5.100% Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 15/07/2050 | 2 090 106          | 0,08  | 229 000 000                                      | 1.200% Czech Republic Government Bond 13/03/2031 | 8 169 283         | 0,31        |
|  |  | <b>42 252 651</b>  | <b>1,62</b>   | 125 600 000                                      | 1.750% Czech Republic Government Bond 23/06/2032 | 4 586 813         | 0,18        |
|  |  |                    |   | 217 200 000                                      | 2.000% Czech Republic Government Bond 13/10/2033 | 7 894 079         | 0,30        |
|  |  |                    |   | 24 000 000                                       | 3.500% Czech Republic Government Bond 30/05/2035 | 994 612           | 0,04        |
|  |  |                    |   | 145 160 000                                      | 4.200% Czech Republic Government Bond 04/12/2036 | 6 425 723         | 0,25        |
|  |  |                    |   | 80 000 000                                       | 1.950% Czech Republic Government Bond 30/07/2037 | 2 694 890         | 0,10        |

## SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD   | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|--------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,78 % (mars 2022 : 97,42 %) (suite)</b> |                    |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,78 % (mars 2022 : 97,42 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 97,78 % (mars 2022 : 97,32 %) (suite)</b> |                    |                   | <b>Obligations d'État – 97,78 % (mars 2022 : 97,32 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Couronne tchèque – 3,88 % (suite)</b>                          |                    |                   | <b>Roupie indonésienne – 9,79 % (suite)</b>                       |                  |                   |
| 60 000 000 1.500% Czech Republic Government Bond 24/04/2040       | 1 760 747          | 0,07              | 106 000 000 000 7.000% Indonesia Treasury Bond 15/05/2027         | 7 231 357        | 0,28              |
|   | <b>101 188 063</b> | <b>3,88</b>       | 194 350 000 000 6.125% Indonesia Treasury Bond 15/05/2028         | 12 795 513       | 0,49              |
| <b>Forint hongrois – 1,79 %</b>                                   |                    |                   | 50 000 000 000 6.375% Indonesia Treasury Bond 15/08/2028          | 3 332 855        | 0,13              |
| 2 082 400 000 5.500% Hungary Government Bond 24/06/2025           | 5 255 293          | 0,20              | 144 800 000 000 8.250% Indonesia Treasury Bond 15/05/2029         | 10 493 256       | 0,40              |
| 2 010 000 000 1.000% Hungary Government Bond 26/11/2025           | 4 507 677          | 0,17              | 170 000 000 000 7.000% Indonesia Treasury Bond 15/09/2030         | 11 592 811       | 0,44              |
| 2 533 000 000 1.500% Hungary Government Bond 22/04/2026           | 5 570 520          | 0,21              | 140 000 000 000 6.500% Indonesia Treasury Bond 15/02/2031         | 9 281 390        | 0,36              |
| 1 365 000 000 1.500% Hungary Government Bond 26/08/2026           | 2 940 547          | 0,11              | 65 000 000 000 8.750% Indonesia Treasury Bond 15/05/2031          | 4 866 991        | 0,19              |
| 1 722 000 000 2.750% Hungary Government Bond 22/12/2026           | 3 819 893          | 0,15              | 193 500 000 000 6.375% Indonesia Treasury Bond 15/04/2032         | 12 650 121       | 0,48              |
| 1 328 330 000 3.000% Hungary Government Bond 27/10/2027           | 2 884 810          | 0,11              | 90 000 000 000 7.500% Indonesia Treasury Bond 15/08/2032          | 6 294 508        | 0,24              |
| 908 000 000 4.500% Hungary Government Bond 23/03/2028             | 2 104 647          | 0,08              | 110 000 000 000 7.000% Indonesia Treasury Bond 15/02/2033         | 7 455 300        | 0,29              |
| 987 140 000 6.750% Hungary Government Bond 22/10/2028             | 2 504 103          | 0,10              | 121 060 000 000 6.625% Indonesia Treasury Bond 15/05/2033         | 7 967 459        | 0,31              |
| 780 000 000 2.000% Hungary Government Bond 23/05/2029             | 1 526 334          | 0,06              | 200 200 000 000 8.375% Indonesia Treasury Bond 15/03/2034         | 14 813 024       | 0,57              |
| 1 604 200 000 3.000% Hungary Government Bond 21/08/2030           | 3 228 469          | 0,12              | 117 500 000 000 7.500% Indonesia Treasury Bond 15/06/2035         | 8 191 579        | 0,31              |
| 2 093 830 000 3.250% Hungary Government Bond 22/10/2031           | 4 116 006          | 0,16              | 37 000 000 000 8.250% Indonesia Treasury Bond 15/05/2036          | 2 727 283        | 0,10              |
| 850 000 000 4.750% Hungary Government Bond 24/11/2032             | 1 840 895          | 0,07              | 45 000 000 000 6.375% Indonesia Treasury Bond 15/07/2037          | 2 859 268        | 0,11              |
| 1 670 000 000 2.250% Hungary Government Bond 20/04/2033           | 2 854 242          | 0,11              | 79 900 000 000 7.500% Indonesia Treasury Bond 15/05/2038          | 5 567 343        | 0,21              |
| 750 000 000 2.250% Hungary Government Bond 22/06/2034             | 1 224 066          | 0,05              | 30 000 000 000 7.125% Indonesia Treasury Bond 15/06/2038          | 2 030 745        | 0,08              |
| 1 150 000 000 3.000% Hungary Government Bond 27/10/2038           | 1 818 398          | 0,07              | 11 500 000 000 10.500% Indonesia Treasury Bond 15/07/2038         | 1 016 129        | 0,04              |
| 400 000 000 3.000% Hungary Government Bond 25/04/2041             | 608 149            | 0,02              | 79 000 000 000 8.375% Indonesia Treasury Bond 15/04/2039          | 5 929 649        | 0,23              |
|   | <b>46 804 049</b>  | <b>1,79</b>       | 155 000 000 000 7.500% Indonesia Treasury Bond 15/04/2040         | 10 790 820       | 0,41              |
| <b>Roupie indonésienne – 9,79 %</b>                               |                    |                   | 115 000 000 000 7.125% Indonesia Treasury Bond 15/06/2042         | 7 746 097        | 0,30              |
| 127 300 000 000 8.125% Indonesia Treasury Bond 15/05/2024         | 8 692 940          | 0,33              | 86 000 000 000 7.125% Indonesia Treasury Bond 15/06/2043          | 5 803 097        | 0,22              |
| 171 010 000 000 6.500% Indonesia Treasury Bond 15/06/2025         | 11 461 873         | 0,44              | 20 300 000 000 8.750% Indonesia Treasury Bond 15/02/2044          | 1 574 098        | 0,06              |
| 38 000 000 000 7.250% Indonesia Treasury Bond 15/02/2026          | 2 591 512          | 0,10              | 64 000 000 000 7.375% Indonesia Treasury Bond 15/05/2048          | 4 379 846        | 0,17              |
| 160 700 000 000 5.500% Indonesia Treasury Bond 15/04/2026         | 10 486 199         | 0,40              | 30 000 000 000 6.875% Indonesia Treasury Bond 15/08/2051          | 1 951 776        | 0,07              |
| 105 700 000 000 8.375% Indonesia Treasury Bond 15/09/2026         | 7 465 016          | 0,29              |   |                  |                   |
| 90 000 000 000 5.125% Indonesia Treasury Bond 15/04/2027          | 5 763 613          | 0,22              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD                                     | % des actifs nets  | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets                          |           |      |
|---|--|--------------------|---|------------------|--|-----------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,78 % (mars 2022 : 97,42 %) (suite)</b> |  |                    | <b>Valeurs mobilières – 97,78 % (mars 2022 : 97,42 %) (suite)</b> |                  |  |           |      |
| <b>Obligations d'État – 97,78 % (mars 2022 : 97,32 %) (suite)</b> |  |                    | <b>Obligations d'État – 97,78 % (mars 2022 : 97,32 %) (suite)</b> |                  |  |           |      |
| <b>Roupie indonésienne – 9,79 % (suite)</b>                       |  |                    | <b>Ringgit malais – 9,82 % (suite)</b>                            |                  |  |           |      |
| 87 000 000 000  | 4.000% Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 15/07/2024 | 5 633 866          | 0,22  | 23 000 000       | 3.955% Malaysia Government Bond 15/09/2025 | 5 297 063 | 0,20 |
| 60 000 000 000  | 6.625% Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 15/10/2024 | 4 010 791          | 0,15  | 6 640 000        | 4.392% Malaysia Government Bond 15/04/2026 | 1 549 208 | 0,06 |
| 80 000 000 000  | 4.875% Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 15/07/2026 | 5 056 627          | 0,19  | 7 400 000        | 3.906% Malaysia Government Bond 15/07/2026 | 1 705 413 | 0,07 |
| 13 725 000 000  | 6.000% Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 15/01/2027 | 898 530            | 0,03  | 12 050 000       | 3.900% Malaysia Government Bond 30/11/2026 | 2 776 648 | 0,11 |
| 210 000 000 000   | 8.875% Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 15/11/2031 | 15 745 413         | 0,60  | 4 410 000        | 3.892% Malaysia Government Bond 15/03/2027 | 1 013 036 | 0,04 |
| 11 382 000 000  | 6.375% Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 15/03/2034 | 717 731            | 0,03  | 19 300 000       | 3.502% Malaysia Government Bond 31/05/2027 | 4 368 864 | 0,17 |
| 122 725 000 000   | 6.750% Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 15/06/2047 | 7 756 610          | 0,30  | 39 000 000       | 3.899% Malaysia Government Bond 16/11/2027 | 8 977 645 | 0,34 |
|   |  | <b>255 623 036</b> | <b>9,79</b>   | 25 400 000       | 3.733% Malaysia Government Bond 15/06/2028 | 5 784 177 | 0,22 |
| <b>Nouveau shekel israélien – 2,89 %</b>                          |  |                    |   | 22 000 000       | 4.504% Malaysia Government Bond 30/04/2029 | 5 173 702 | 0,20 |
| 31 600 000  | 0.500% Israel Government Bond - Fixed 30/04/2025     | 8 165 721          | 0,31  | 22 350 000       | 3.885% Malaysia Government Bond 15/08/2029 | 5 073 463 | 0,19 |
| 31 500 000  | 1.750% Israel Government Bond - Fixed 31/08/2025     | 8 297 877          | 0,32  | 23 100 000       | 4.498% Malaysia Government Bond 15/04/2030 | 5 456 730 | 0,21 |
| 21 400 000  | 0.500% Israel Government Bond - Fixed 27/02/2026     | 5 387 844          | 0,21  | 10 200 000       | 2.632% Malaysia Government Bond 15/04/2031 | 2 109 418 | 0,08 |
| 22 900 000  | 6.250% Israel Government Bond - Fixed 30/10/2026     | 6 859 220          | 0,26  | 20 000 000       | 4.232% Malaysia Government Bond 30/06/2031 | 4 635 467 | 0,18 |
| 25 230 000  | 2.000% Israel Government Bond - Fixed 31/03/2027     | 6 545 723          | 0,25  | 10 000 000       | 3.582% Malaysia Government Bond 15/07/2032 | 2 210 969 | 0,08 |
| 27 920 000  | 2.250% Israel Government Bond - Fixed 28/09/2028     | 7 182 597          | 0,27  | 17 500 000       | 3.844% Malaysia Government Bond 15/04/2033 | 3 917 065 | 0,15 |
| 34 700 000  | 1.000% Israel Government Bond - Fixed 31/03/2030     | 8 034 491          | 0,31  | 15 000 000       | 4.642% Malaysia Government Bond 07/11/2033 | 3 605 983 | 0,14 |
| 9 900 000   | 1.300% Israel Government Bond - Fixed 30/04/2032     | 2 240 268          | 0,09  | 20 000 000       | 3.828% Malaysia Government Bond 05/07/2034 | 4 430 731 | 0,17 |
| 24 250 000  | 1.500% Israel Government Bond - Fixed 31/05/2037     | 4 984 832          | 0,19  | 19 650 000       | 4.254% Malaysia Government Bond 31/05/2035 | 4 502 511 | 0,17 |
| 22 929 000  | 5.500% Israel Government Bond - Fixed 31/01/2042     | 7 617 740          | 0,29  | 34 400 000       | 4.762% Malaysia Government Bond 07/04/2037 | 8 258 495 | 0,32 |
| 31 750 000  | 3.750% Israel Government Bond - Fixed 31/03/2047     | 8 417 963          | 0,32  | 25 000 000       | 4.893% Malaysia Government Bond 08/06/2038 | 6 132 181 | 0,23 |
| 8 000 000   | 2.800% Israel Government Bond - Fixed 29/11/2052     | 1 727 799          | 0,07  | 32 300 000       | 3.757% Malaysia Government Bond 22/05/2040 | 6 897 304 | 0,26 |
|   |  | <b>75 462 075</b>  | <b>2,89</b>   | 17 000 000       | 4.696% Malaysia Government Bond 15/10/2042 | 4 111 284 | 0,16 |
| <b>Ringgit malais – 9,82 %</b>                                    |  |                    |   | 6 800 000        | 4.935% Malaysia Government Bond 30/09/2043 | 1 674 688 | 0,06 |
| 28 300 000  | 3.478% Malaysia Government Bond 14/06/2024           | 6 450 091          | 0,25  | 9 000 000        | 4.736% Malaysia Government Bond 15/03/2046 | 2 148 374 | 0,08 |
| 13 000 000  | 4.181% Malaysia Government Bond 15/07/2024           | 2 988 925          | 0,11  | 10 153 000       | 4.921% Malaysia Government Bond 06/07/2048 | 2 483 936 | 0,10 |
| 12 100 000  | 4.059% Malaysia Government Bond 30/09/2024           | 2 783 014          | 0,11  |                  |  |           |      |
| 22 000 000  | 3.882% Malaysia Government Bond 14/03/2025           | 5 050 502          | 0,19  |                  |  |           |      |



## SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD                                       | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD                     | % des actifs nets  |                    |             |
|---|--|-------------------|---|--------------------------------------|--|--------------------|-------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,78 % (mars 2022 : 97,42 %) (suite)</b> |  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,78 % (mars 2022 : 97,42 %) (suite)</b> |                                      |  |                    |             |
| <b>Obligations d'État – 97,78 % (mars 2022 : 97,32 %) (suite)</b> |  |                   | <b>Obligations d'État – 97,78 % (mars 2022 : 97,32 %) (suite)</b> |                                      |  |                    |             |
| <b>Ringgit malais – 9,82 % (suite)</b>                            |  |                   | <b>Ringgit malais – 9,82 % (suite)</b>                            |                                      |  |                    |             |
| 33 000 000  | 4.065% Malaysia Government Bond 15/06/2050             | 7 057 475         | 0,27  | 14 300 000                           | 4.895% Malaysia Government Investment Issue 08/05/2047   | 3 478 019          | 0,13        |
| 24 000 000  | 4.045% Malaysia Government Investment Issue 15/08/2024 | 5 505 396         | 0,21  | 24 670 000                           | 4.638% Malaysia Government Investment Issue 15/11/2049   | 5 750 780          | 0,22        |
| 32 500 000  | 3.655% Malaysia Government Investment Issue 15/10/2024 | 7 422 006         | 0,28  | 9 000 000                            | 5.357% Malaysia Government Investment Issue 15/05/2052   | 2 337 838          | 0,09        |
| 13 800 000  | 4.128% Malaysia Government Investment Issue 15/08/2025 | 3 183 930         | 0,12  |                                      |  | <b>256 371 502</b> | <b>9,82</b> |
| 37 500 000  | 3.990% Malaysia Government Investment Issue 15/10/2025 | 8 640 085         | 0,33  | <b>Peso mexicain – 8,93 %</b>        |  |                    |             |
| 26 600 000  | 3.726% Malaysia Government Investment Issue 31/03/2026 | 6 069 382         | 0,23  | 79 700 000                           | 8.000% Mexican Bonos 05/09/2024                          | 4 256 640          | 0,16        |
| 42 800 000  | 4.070% Malaysia Government Investment Issue 30/09/2026 | 9 891 383         | 0,38  | 643 440 000                          | 10.000% Mexican Bonos 05/12/2024                         | 35 409 869         | 1,36        |
| 19 600 000  | 4.258% Malaysia Government Investment Issue 26/07/2027 | 4 561 814         | 0,17  | 196 000 000                          | 5.000% Mexican Bonos 06/03/2025                          | 9 851 887          | 0,38        |
| 7 700 000   | 3.422% Malaysia Government Investment Issue 30/09/2027 | 1 733 996         | 0,07  | 501 000 000                          | 5.750% Mexican Bonos 05/03/2026                          | 25 074 972         | 0,96        |
| 12 500 000  | 3.599% Malaysia Government Investment Issue 31/07/2028 | 2 832 096         | 0,11  | 262 000 000                          | 5.500% Mexican Bonos 04/03/2027                          | 12 794 846         | 0,49        |
| 27 950 000  | 4.369% Malaysia Government Investment Issue 31/10/2028 | 6 554 014         | 0,25  | 468 480 000                          | 7.500% Mexican Bonos 03/06/2027                          | 24 640 087         | 0,94        |
| 6 200 000   | 4.943% Malaysia Government Investment Issue 06/12/2028 | 1 494 323         | 0,06  | 351 170 000                          | 8.500% Mexican Bonos 31/05/2029                          | 19 159 731         | 0,73        |
| 25 000 000  | 4.130% Malaysia Government Investment Issue 09/07/2029 | 5 749 065         | 0,22  | 586 040 000                          | 7.750% Mexican Bonos 29/05/2031                          | 30 434 093         | 1,17        |
| 35 000 000  | 3.465% Malaysia Government Investment Issue 15/10/2030 | 7 706 266         | 0,30  | 110 000 000                          | 7.500% Mexican Bonos 26/05/2033                          | 5 547 580          | 0,21        |
| 36 000 000  | 4.193% Malaysia Government Investment Issue 07/10/2032 | 8 311 912         | 0,32  | 99 300 000                           | 7.750% Mexican Bonos 23/11/2034                          | 5 076 201          | 0,20        |
| 16 995 000  | 4.724% Malaysia Government Investment Issue 15/06/2033 | 4 078 376         | 0,16  | 81 687 000                           | 10.000% Mexican Bonos 20/11/2036                         | 4 956 142          | 0,19        |
| 7 200 000   | 4.582% Malaysia Government Investment Issue 30/08/2033 | 1 709 855         | 0,07  | 297 220 000                          | 8.500% Mexican Bonos 18/11/2038                          | 15 756 150         | 0,60        |
| 24 000 000  | 4.119% Malaysia Government Investment Issue 30/11/2034 | 5 447 415         | 0,21  | 340 420 000                          | 7.750% Mexican Bonos 13/11/2042                          | 16 506 298         | 0,63        |
| 2 200 000   | 4.786% Malaysia Government Investment Issue 31/10/2035 | 528 997           | 0,02  | 329 420 000                          | 8.000% Mexican Bonos 07/11/2047                          | 16 323 586         | 0,63        |
| 22 000 000  | 3.447% Malaysia Government Investment Issue 15/07/2036 | 4 614 191         | 0,18  | 117 500 000                          | 8.000% Mexican Bonos 31/07/2053                          | 5 795 348          | 0,22        |
| 15 440 000  | 4.755% Malaysia Government Investment Issue 04/08/2037 | 3 708 224         | 0,14  | 337 000 000                          | 0.000% Mexico Cetes 28/11/2024                           | 1 567 602          | 0,06        |
| 10 000 000  | 4.662% Malaysia Government Investment Issue 31/03/2038 | 2 390 483         | 0,09  |                                      |  | <b>233 151 032</b> | <b>8,93</b> |
| 39 500 000  | 4.467% Malaysia Government Investment Issue 15/09/2039 | 9 200 076         | 0,35  | <b>Nouveau sol péruvien – 1,40 %</b> |  |                    |             |
| 13 000 000  | 4.417% Malaysia Government Investment Issue 30/09/2041 | 3 006 189         | 0,12  | 13 800 000                           | 8.200% Peru Government Bond 12/08/2026                   | 3 843 328          | 0,15        |
| 8 000 000   | 4.291% Malaysia Government Investment Issue 14/08/2043 | 1 841 029         | 0,07  | 19 320 000                           | 6.350% Peru Government Bond 12/08/2028                   | 5 013 270          | 0,19        |
|   |  |                   |   | 24 650 000                           | 5.940% Peru Government Bond 12/02/2029                   | 6 201 808          | 0,24        |
|   |  |                   |   | 10 220 000                           | 6.950% Peru Government Bond 12/08/2031                   | 2 650 670          | 0,10        |
|   |  |                   |   | 17 250 000                           | 6.150% Peru Government Bond 12/08/2032                   | 4 202 505          | 0,16        |
|   |  |                   |   | 19 000 000                           | 5.400% Peru Government Bond 12/08/2034                   | 4 250 720          | 0,16        |
|   |  |                   |   | 200 000                              | 6.900% Peru Government Bond 12/08/2037                   | 49 964             | 0,00        |
|   |  |                   |   | 8 200 000                            | 5.350% Peru Government Bond 12/08/2040                   | 1 712 210          | 0,07        |
|   |  |                   |   | 4 000 000                            | 6.850% Peru Government Bond 12/02/2042                   | 982 024            | 0,04        |
|   |  |                   |   | 6 510 000                            | 6.350% Peruvian Government International Bond 12/08/2028 | 1 689 254          | 0,06        |
|   |  |                   |   | 21 560 000                           | 6.900% Peruvian Government International Bond 12/08/2037 | 5 365 694          | 0,20        |

## SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD   | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|--|--------------------|-------------------|---|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,78 % (mars 2022 : 97,42 %) (suite)</b>      |                    |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,78 % (mars 2022 : 97,42 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Obligations d'État – 97,78 % (mars 2022 : 97,32 %) (suite)</b>      |                    |                   | <b>Obligations d'État – 97,78 % (mars 2022 : 97,32 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Nouveau sol péruvien – 1,40 % (suite)</b>                           |                    |                   | <b>Zloty polonais – 4,51 %</b>                                    |                    |                   |
| 2 950 000 6.850% Peruvian Government International Bond 12/02/2042     | 724 242            | 0,03              | 51 500 000 0.000% Republic of Poland Government Bond 25/07/2024   | 11 068 187         | 0,42              |
|  | <b>36 685 689</b>  | <b>1,40</b>       | 40 600 000 2.250% Republic of Poland Government Bond 25/10/2024   | 8 901 456          | 0,34              |
| <b>Peso philippin – 4,05 %</b>   |                    |                   | 22 800 000 0.750% Republic of Poland Government Bond 25/04/2025   | 4 765 134          | 0,18              |
| 172 500 000 4.125% Philippine Government Bond 20/08/2024               | 3 100 494          | 0,12              | 9 300 000 3.250% Republic of Poland Government Bond 25/07/2025    | 2 033 477          | 0,08              |
| 90 000 000 5.750% Philippine Government Bond 12/04/2025                | 1 655 957          | 0,06              | 55 000 000 2.500% Republic of Poland Government Bond 25/07/2026   | 11 462 030         | 0,44              |
| 742 029 646 3.625% Philippine Government Bond 09/09/2025               | 12 948 973         | 0,50              | 64 000 000 0.250% Republic of Poland Government Bond 25/10/2026   | 12 196 702         | 0,47              |
| 332 000 000 6.250% Philippine Government Bond 14/02/2026               | 6 166 595          | 0,24              | 111 400 000 3.750% Republic of Poland Government Bond 25/05/2027  | 23 805 656         | 0,91              |
| 510 000 000 3.375% Philippine Government Bond 08/04/2026               | 8 741 437          | 0,33              | 98 900 000 2.500% Republic of Poland Government Bond 25/07/2027   | 19 999 928         | 0,77              |
| 115 000 000 4.750% Philippine Government Bond 04/05/2027               | 2 026 297          | 0,08              | 26 500 000 2.750% Republic of Poland Government Bond 25/10/2029   | 5 105 066          | 0,20              |
| 155 000 000 8.625% Philippine Government Bond 06/09/2027               | 3 153 230          | 0,12              | 38 000 000 1.250% Republic of Poland Government Bond 25/10/2030   | 6 345 873          | 0,24              |
| 102 700 000 6.250% Philippine Government Bond 22/03/2028               | 1 913 150          | 0,07              | 58 500 000 1.750% Republic of Poland Government Bond 25/04/2032   | 9 630 933          | 0,37              |
| 409 500 000 3.625% Philippine Government Bond 22/04/2028               | 6 766 825          | 0,26              | 10 500 000 6.000% Republic of Poland Government Bond 25/10/2033   | 2 427 253          | 0,09              |
| 432 400 000 6.875% Philippine Government Bond 10/01/2029               | 8 274 735          | 0,32              |   | <b>117 741 695</b> | <b>4,51</b>       |
| 80 000 000 7.000% Philippine Government Bond 13/10/2029                | 1 543 052          | 0,06              | <b>Leu roumain – 2,09 %</b>                                       |                    |                   |
| 255 000 000 2.875% Philippine Government Bond 09/07/2030               | 3 807 528          | 0,15              | 18 400 000 3.700% Romania Government Bond 25/11/2024              | 3 843 969          | 0,15              |
| 357 500 000 8.000% Philippine Government Bond 19/07/2031               | 7 328 405          | 0,28              | 23 250 000 4.750% Romania Government Bond 24/02/2025              | 4 907 837          | 0,19              |
| 390 000 000 4.000% Philippine Government Bond 22/07/2031               | 6 137 559          | 0,23              | 20 000 000 3.650% Romania Government Bond 28/07/2025              | 4 078 221          | 0,16              |
| 68 500 000 4.875% Philippine Government Bond 20/01/2032                | 1 152 788          | 0,04              | 13 400 000 3.500% Romania Government Bond 25/11/2025              | 2 688 092          | 0,10              |
| 190 000 000 7.250% Philippine Government Bond 23/06/2032               | 3 762 989          | 0,14              | 21 690 000 4.850% Romania Government Bond 22/04/2026              | 4 467 604          | 0,17              |
| 279 400 000 3.625% Philippine Government Bond 21/03/2033               | 4 161 115          | 0,16              | 19 000 000 3.250% Romania Government Bond 24/06/2026              | 3 711 003          | 0,14              |
| 176 160 000 9.250% Philippine Government Bond 05/11/2034               | 4 047 581          | 0,15              | 18 300 000 5.800% Romania Government Bond 26/07/2027              | 3 804 190          | 0,15              |
| 210 000 000 8.000% Philippine Government Bond 30/09/2035               | 4 433 853          | 0,17              | 14 000 000 2.500% Romania Government Bond 25/10/2027              | 2 522 813          | 0,10              |
| 254 400 000 8.125% Philippine Government Bond 16/12/2035               | 5 425 952          | 0,21              | 15 500 000 4.150% Romania Government Bond 26/01/2028              | 2 983 488          | 0,11              |
| 30 000 000 6.750% Philippine Government Bond 24/01/2039                | 571 007            | 0,02              | 20 625 000 5.000% Romania Government Bond 12/02/2029              | 4 040 666          | 0,15              |
| 361 522 542 4.625% Philippine Government Bond 09/09/2040               | 5 394 410          | 0,21              | 8 800 000 4.850% Romania Government Bond 25/07/2029               | 1 692 093          | 0,06              |
| 184 000 000 6.250% Philippine Government International Bond 14/01/2036 | 3 308 819          | 0,13              | 17 000 000 4.150% Romania Government Bond 24/10/2030              | 3 053 933          | 0,12              |
|  | <b>105 822 751</b> | <b>4,05</b>       |   |                    |                   |

## SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD   | % des actifs nets       | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD                         | % des actifs nets |
|---|--|-------------------------|---|--|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,78 % (mars 2022 : 97,42 %) (suite)</b> |  |                         | <b>Valeurs mobilières – 97,78 % (mars 2022 : 97,42 %) (suite)</b> |  |                   |
| <b>Obligations d'État – 97,78 % (mars 2022 : 97,32 %) (suite)</b> |  |                         | <b>Obligations d'État – 97,78 % (mars 2022 : 97,32 %) (suite)</b> |  |                   |
| <b>Leu roumain – 2,09 % (suite)</b>                               |  |                         | <b>Won sud-coréen – 9,85 % (suite)</b>                            |  |                   |
| 21 450 000  | 3.650% Romania Government Bond<br>24/09/2031                   | 3 623 619 0,14          | 7 600 000 000   | 2.250% Korea Treasury Bond<br>10/06/2025 | 5 704 918 0,22    |
| 18 000 000  | 6.700% Romania Government Bond<br>25/02/2032                   | 3 772 223 0,14          | 4 500 000 000   | 3.125% Korea Treasury Bond<br>10/06/2025 | 3 442 586 0,13    |
| 4 300 000   | 8.250% Romania Government Bond<br>29/09/2032                   | 993 483 0,04            | 4 300 000 000   | 1.125% Korea Treasury Bond<br>10/09/2025 | 3 134 110 0,12    |
| 11 800 000  | 4.750% Romania Government Bond<br>11/10/2034                   | 2 049 022 0,08          | 2 000 000 000   | 4.250% Korea Treasury Bond<br>10/12/2025 | 1 574 083 0,06    |
| 15 000 000  | 4.250% Romania Government Bond<br>28/04/2036                   | 2 400 659 0,09          | 10 000 000 000  | 1.250% Korea Treasury Bond<br>10/03/2026 | 7 237 700 0,28    |
|   |  | <b>54 632 915 2,09</b>  | 11 070 000 000  | 1.875% Korea Treasury Bond<br>10/06/2026 | 8 129 394 0,31    |
| <b>Rand sud-africain – 6,05 %</b>                                 |  |                         | 12 180 000 000  | 1.500% Korea Treasury Bond<br>10/12/2026 | 8 762 097 0,34    |
| 422 378 654   | 10.500% Republic of South Africa<br>Government Bond 21/12/2026 | 25 347 464 0,97         | 10 000 000 000  | 2.375% Korea Treasury Bond<br>10/03/2027 | 7 426 320 0,28    |
| 426 344 000   | 8.000% Republic of South Africa<br>Government Bond 31/01/2030  | 21 886 232 0,84         | 6 020 000 000   | 2.125% Korea Treasury Bond<br>10/06/2027 | 4 399 915 0,17    |
| 217 096 000   | 7.000% Republic of South Africa<br>Government Bond 28/02/2031  | 10 124 131 0,39         | 6 500 000 000   | 3.125% Korea Treasury Bond<br>10/09/2027 | 4 965 794 0,19    |
| 348 300 000   | 8.250% Republic of South Africa<br>Government Bond 31/03/2032  | 17 127 310 0,66         | 6 220 000 000   | 2.375% Korea Treasury Bond<br>10/12/2027 | 4 574 329 0,17    |
| 345 493 000   | 8.875% Republic of South Africa<br>Government Bond 28/02/2035  | 16 701 863 0,64         | 5 750 000 000   | 2.625% Korea Treasury Bond<br>10/06/2028 | 4 257 389 0,16    |
| 142 000 000   | 6.250% Republic of South Africa<br>Government Bond 31/03/2036  | 5 373 951 0,21          | 3 350 000 000   | 2.375% Korea Treasury Bond<br>10/12/2028 | 2 437 856 0,09    |
| 320 724 000   | 8.500% Republic of South Africa<br>Government Bond 31/01/2037  | 14 550 394 0,56         | 3 680 000 000   | 1.875% Korea Treasury Bond<br>10/06/2029 | 2 591 109 0,10    |
| 230 900 000   | 9.000% Republic of South Africa<br>Government Bond 31/01/2040  | 10 582 684 0,40         | 10 000 000 000  | 1.375% Korea Treasury Bond<br>10/12/2029 | 6 760 149 0,26    |
| 105 000 000   | 6.500% Republic of South Africa<br>Government Bond 28/02/2041  | 3 721 945 0,14          | 13 500 000 000  | 1.375% Korea Treasury Bond<br>10/06/2030 | 9 044 176 0,35    |
| 277 368 000   | 8.750% Republic of South Africa<br>Government Bond 31/01/2044  | 12 103 828 0,46         | 16 000 000 000  | 1.500% Korea Treasury Bond<br>10/12/2030 | 10 748 888 0,41   |
| 472 620 000   | 8.750% Republic of South Africa<br>Government Bond 28/02/2048  | 20 446 592 0,78         | 15 000 000 000  | 2.000% Korea Treasury Bond<br>10/06/2031 | 10 389 331 0,40   |
|   |  | <b>157 966 394 6,05</b> | 8 000 000 000   | 2.375% Korea Treasury Bond<br>10/12/2031 | 5 687 660 0,22    |
| <b>Won sud-coréen – 9,85 %</b>                                    |  |                         | 3 000 000 000   | 4.000% Korea Treasury Bond<br>10/12/2031 | 2 407 628 0,09    |
| 6 700 000 000   | 1.125% Korea Treasury Bond<br>10/06/2024                       | 5 018 237 0,19          | 7 000 000 000   | 3.375% Korea Treasury Bond<br>10/06/2032 | 5 374 060 0,21    |
| 6 900 000 000   | 1.375% Korea Treasury Bond<br>10/09/2024                       | 5 156 728 0,20          | 9 000 000 000   | 4.250% Korea Treasury Bond<br>10/12/2032 | 7 482 246 0,29    |
| 10 000 000 000  | 3.000% Korea Treasury Bond<br>10/09/2024                       | 7 642 816 0,29          | 2 500 000 000   | 3.750% Korea Treasury Bond<br>10/12/2033 | 1 988 047 0,08    |
| 2 000 000 000   | 3.125% Korea Treasury Bond<br>10/09/2024                       | 1 532 081 0,06          | 9 000 000 000   | 2.625% Korea Treasury Bond<br>10/09/2035 | 6 411 960 0,25    |
| 10 000 000 000  | 1.875% Korea Treasury Bond<br>10/12/2024                       | 7 497 408 0,29          | 5 000 000 000   | 1.500% Korea Treasury Bond<br>10/09/2036 | 3 072 896 0,12    |
| 2 000 000 000   | 4.250% Korea Treasury Bond<br>10/12/2024                       | 1 559 304 0,06          |   |  |                   |
| 6 500 000 000   | 1.500% Korea Treasury Bond<br>10/03/2025                       | 4 821 289 0,18          |   |  |                   |

## SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD                              | % des actifs nets  | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets                             |            |      |
|---|---|--------------------|---|------------------|---|------------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,78 % (mars 2022 : 97,42 %) (suite)</b> |   |                    | <b>Valeurs mobilières – 97,78 % (mars 2022 : 97,42 %) (suite)</b> |                  |   |            |      |
| <b>Obligations d'État – 97,78 % (mars 2022 : 97,32 %) (suite)</b> |   |                    | <b>Obligations d'État – 97,78 % (mars 2022 : 97,32 %) (suite)</b> |                  |   |            |      |
| <b>Won sud-coréen – 9,85 % (suite)</b>                            |   |                    | <b>Baht thaïlandais – 8,73 % (suite)</b>                          |                  |   |            |      |
| 4 250 000 000   | 2.250% Korea Treasury Bond<br>10/09/2037      | 2 857 165          | 0,11  | 397 100 000      | 2.125% Thailand Government Bond<br>17/12/2026 | 11 701 879 | 0,45 |
| 3 800 000 000   | 1.125% Korea Treasury Bond<br>10/09/2039      | 2 110 702          | 0,08  | 186 000 000      | 1.000% Thailand Government Bond<br>17/06/2027 | 5 231 226  | 0,20 |
| 5 000 000 000   | 1.500% Korea Treasury Bond<br>10/09/2040      | 2 895 072          | 0,11  | 94 550 000       | 3.580% Thailand Government Bond<br>17/12/2027 | 2 967 341  | 0,11 |
| 5 000 000 000   | 1.875% Korea Treasury Bond<br>10/09/2041      | 3 058 340          | 0,12  | 20 072 000       | 5.670% Thailand Government Bond<br>13/03/2028 | 686 481    | 0,03 |
| 4 000 000 000   | 3.250% Korea Treasury Bond<br>10/09/2042      | 3 019 825          | 0,12  | 116 000 000      | 2.650% Thailand Government Bond<br>17/06/2028 | 3 493 705  | 0,13 |
| 2 000 000 000   | 3.000% Korea Treasury Bond<br>10/12/2042      | 1 451 058          | 0,05  | 281 300 000      | 2.875% Thailand Government Bond<br>17/12/2028 | 8 585 840  | 0,33 |
| 500 000 000   | 2.750% Korea Treasury Bond<br>10/12/2044      | 346 776            | 0,01  | 407 060 000      | 4.875% Thailand Government Bond<br>22/06/2029 | 13 792 067 | 0,53 |
| 10 250 000 000  | 2.000% Korea Treasury Bond<br>10/03/2046      | 6 142 048          | 0,23  | 200 000 000      | 1.600% Thailand Government Bond<br>17/12/2029 | 5 643 398  | 0,22 |
| 16 500 000 000  | 2.125% Korea Treasury Bond<br>10/03/2047      | 10 069 328         | 0,39  | 444 000 000      | 3.650% Thailand Government Bond<br>20/06/2031 | 14 315 381 | 0,55 |
| 14 550 000 000  | 2.625% Korea Treasury Bond<br>10/03/2048      | 9 839 705          | 0,38  | 348 100 000      | 2.000% Thailand Government Bond<br>17/12/2031 | 9 933 498  | 0,38 |
| 17 500 000 000  | 2.000% Korea Treasury Bond<br>10/03/2049      | 10 253 735         | 0,39  | 426 300 000      | 3.775% Thailand Government Bond<br>25/06/2032 | 13 953 767 | 0,53 |
| 18 300 000 000  | 1.500% Korea Treasury Bond<br>10/03/2050      | 9 443 860          | 0,36  | 75 000 000       | 3.350% Thailand Government Bond<br>17/06/2033 | 2 374 974  | 0,09 |
| 21 000 000 000  | 1.875% Korea Treasury Bond<br>10/03/2051      | 11 810 070         | 0,45  | 145 000 000      | 1.600% Thailand Government Bond<br>17/06/2035 | 3 823 090  | 0,15 |
| 7 000 000 000   | 2.500% Korea Treasury Bond<br>10/03/2052      | 4 503 099          | 0,17  | 310 000 000      | 1.585% Thailand Government Bond<br>17/12/2035 | 8 102 881  | 0,31 |
| 6 500 000 000   | 3.125% Korea Treasury Bond<br>10/09/2052      | 4 771 740          | 0,18  | 279 200 000      | 3.400% Thailand Government Bond<br>17/06/2036 | 8 833 563  | 0,34 |
| 3 000 000 000   | 3.250% Korea Treasury Bond<br>10/03/2053      | 2 274 225          | 0,09  | 90 000 000       | 3.390% Thailand Government Bond<br>17/06/2037 | 2 858 128  | 0,11 |
| 1 000 000 000   | 2.000% Korea Treasury Bond<br>10/09/2068      | 530 588            | 0,02  | 275 800 000      | 3.300% Thailand Government Bond<br>17/06/2038 | 8 600 653  | 0,33 |
| 1 000 000 000   | 1.625% Korea Treasury Bond<br>10/09/2070      | 458 149            | 0,02  | 127 000 000      | 3.800% Thailand Government Bond<br>14/06/2041 | 4 261 844  | 0,16 |
|   |   | <b>257 067 989</b> | <b>9,85</b>   | 200 000 000      | 2.000% Thailand Government Bond<br>17/06/2042 | 5 121 626  | 0,20 |
| <b>Baht thaïlandais – 8,73 %</b>                                  |   |                    |   | 344 525 000      | 4.675% Thailand Government Bond<br>29/06/2044 | 12 904 146 | 0,49 |
| 229 000 000   | 0.750% Thailand Government Bond<br>17/06/2024 | 6 618 934          | 0,25  | 140 011 000      | 2.875% Thailand Government Bond<br>17/06/2046 | 4 007 316  | 0,15 |
| 315 000 000   | 0.750% Thailand Government Bond<br>17/09/2024 | 9 080 788          | 0,35  | 20 000 000       | 1.875% Thailand Government Bond<br>17/06/2049 | 462 442    | 0,02 |
| 402 800 000   | 1.450% Thailand Government Bond<br>17/12/2024 | 11 710 825         | 0,45  | 20 000 000       | 2.750% Thailand Government Bond<br>17/06/2052 | 551 461    | 0,02 |
| 277 000 000   | 0.950% Thailand Government Bond<br>17/06/2025 | 7 945 230          | 0,30  | 247 000 000      | 4.850% Thailand Government Bond<br>17/06/2061 | 9 269 200  | 0,36 |
| 382 500 000   | 3.850% Thailand Government Bond<br>12/12/2025 | 11 781 940         | 0,45  | 332 100 000      | 4.000% Thailand Government Bond<br>17/06/2066 | 10 739 470 | 0,41 |
| 85 000 000  | 2.350% Thailand Government Bond<br>17/06/2026 | 2 521 091          | 0,10  |                  |   |            |      |

## SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD   | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|--------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,78 % (mars 2022 : 97,42 %) (suite)</b> |                    |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,78 % (mars 2022 : 97,42 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 97,78 % (mars 2022 : 97,32 %) (suite)</b> |                    |                   | <b>Obligations d'État – 97,78 % (mars 2022 : 97,32 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Baht thaïlandais – 8,73 % (suite)</b>                          |                    |                   | <b>Yuan Renminbi – 9,80 % (suite)</b>                             |                  |                   |
| 194 800 000 3.600% Thailand Government Bond<br>17/06/2067         | 5 802 300          | 0,22              | 10 000 000 3.570% China Government Bond<br>22/06/2024             | 1 480 460        | 0,06              |
| 10 000 000 2.500% Thailand Government Bond<br>17/06/2071          | 222 041            | 0,01              | 49 000 000 2.470% China Government Bond<br>02/09/2024             | 7 142 091        | 0,27              |
|   | <b>227 898 526</b> | <b>8,73</b>       | 3 000 000 1.990% China Government Bond<br>15/09/2024              | 434 590          | 0,02              |
| <b>Lire turque – 1,68 %</b>                                       |                    |                   | 17 000 000 3.690% China Government Bond<br>21/09/2024             | 2 530 042        | 0,10              |
| 50 000 000 9.000% Turkey Government Bond<br>24/07/2024            | 2 482 704          | 0,09              | 43 000 000 2.940% China Government Bond<br>17/10/2024             | 6 315 919        | 0,24              |
| 62 060 000 12.600% Turkey Government Bond<br>01/10/2025           | 3 310 923          | 0,13              | 5 000 000 2.290% China Government Bond<br>25/12/2024              | 726 711          | 0,03              |
| 41 700 000 10.600% Turkey Government Bond<br>11/02/2026           | 2 039 574          | 0,08              | 27 000 000 2.260% China Government Bond<br>24/02/2025             | 3 917 757        | 0,15              |
| 94 000 000 16.900% Turkey Government Bond<br>02/09/2026           | 5 543 331          | 0,21              | 20 000 000 3.770% China Government Bond<br>08/03/2025             | 2 996 864        | 0,11              |
| 50 872 000 11.000% Turkey Government Bond<br>24/02/2027           | 2 514 182          | 0,10              | 41 000 000 1.990% China Government Bond<br>09/04/2025             | 5 912 494        | 0,23              |
| 50 000 000 20.200% Turkey Government Bond<br>09/06/2027           | 3 269 237          | 0,12              | 17 000 000 2.240% China Government Bond<br>25/05/2025             | 2 462 976        | 0,09              |
| 97 007 092 10.500% Turkey Government Bond<br>11/08/2027           | 4 928 637          | 0,19              | 10 000 000 3.610% China Government Bond<br>07/06/2025             | 1 497 588        | 0,06              |
| 75 000 000 10.280% Turkey Government Bond<br>15/09/2027           | 3 839 037          | 0,15              | 25 000 000 2.180% China Government Bond<br>25/08/2025             | 3 612 855        | 0,14              |
| 17 564 000 12.400% Turkey Government Bond<br>08/03/2028           | 965 302            | 0,04              | 20 000 000 2.990% China Government Bond<br>15/10/2025             | 2 951 782        | 0,11              |
| 119 300 000 11.700% Turkey Government Bond<br>13/11/2030          | 6 746 680          | 0,26              | 30 000 000 3.020% China Government Bond<br>22/10/2025             | 4 428 633        | 0,17              |
| 32 000 000 21.500% Turkey Government Bond<br>28/04/2032           | 2 948 018          | 0,11              | 20 000 000 2.280% China Government Bond<br>25/11/2025             | 2 894 679        | 0,11              |
| 100 000 000 10.400% Turkey Government Bond<br>13/10/2032          | 5 252 149          | 0,20              | 20 000 000 3.220% China Government Bond<br>06/12/2025             | 2 970 903        | 0,11              |
|   | <b>43 839 774</b>  | <b>1,68</b>       | 5 000 000 2.460% China Government Bond<br>15/02/2026              | 726 935          | 0,03              |
| <b>Yuan Renminbi – 9,80 %</b>                                     |                    |                   | 25 000 000 3.030% China Government Bond<br>11/03/2026             | 3 695 148        | 0,14              |
| 5 000 000 3.420% China Development Bank<br>02/07/2024             | 736 170            | 0,03              | 10 000 000 2.900% China Government Bond<br>05/05/2026             | 1 471 190        | 0,06              |
| 20 000 000 4.300% China Development Bank<br>21/08/2024            | 2 980 769          | 0,11              | 30 000 000 3.250% China Government Bond<br>06/06/2026             | 4 470 761        | 0,17              |
| 43 000 000 4.210% China Development Bank<br>13/04/2025            | 6 452 456          | 0,25              | 22 790 000 2.690% China Government Bond<br>12/08/2026             | 3 328 235        | 0,13              |
| 26 000 000 3.680% China Development Bank<br>26/02/2026            | 3 888 621          | 0,15              | 5 100 000 3.120% China Government Bond<br>05/12/2026              | 756 823          | 0,03              |
| 18 000 000 3.500% China Development Bank<br>13/08/2026            | 2 682 142          | 0,10              | 17 000 000 2.370% China Government Bond<br>20/01/2027             | 2 452 437        | 0,09              |
| 10 000 000 4.040% China Development Bank<br>06/07/2028            | 1 534 594          | 0,06              | 10 000 000 3.400% China Government Bond<br>09/02/2027             | 1 504 166        | 0,06              |
| 25 000 000 3.480% China Development Bank<br>08/01/2029            | 3 737 603          | 0,14              | 16 000 000 2.480% China Government Bond<br>15/04/2027             | 2 315 068        | 0,09              |
| 13 000 000 2.840% China Government Bond<br>08/04/2024             | 1 903 524          | 0,07              |   |                  |                   |
| 34 000 000 3.190% China Government Bond<br>11/04/2024             | 5 000 464          | 0,19              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,78 % (mars 2022 : 97,42 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,78 % (mars 2022 : 97,42 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 97,78 % (mars 2022 : 97,32 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 97,78 % (mars 2022 : 97,32 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Yuan Renminbi – 9,80 % (suite)</b>                             |                  |                   | <b>Yuan Renminbi – 9,80 % (suite)</b>                             |                  |                   |
| 10 000 000 3.520% China Government Bond<br>04/05/2027             | 1 511 427        | 0,06              | 24 000 000 2.890% China Government Bond<br>18/11/2031             | 3 499 285        | 0,13              |
| 30 000 000 2.850% China Government Bond<br>04/06/2027             | 4 399 383        | 0,17              | 25 000 000 2.750% China Government Bond<br>17/02/2032             | 3 603 542        | 0,14              |
| 12 000 000 2.500% China Government Bond<br>25/07/2027             | 1 734 031        | 0,07              | 25 000 000 2.760% China Government Bond<br>15/05/2032             | 3 605 470        | 0,14              |
| 10 000 000 3.590% China Government Bond<br>03/08/2027             | 1 520 318        | 0,06              | 27 000 000 2.690% China Government Bond<br>15/08/2032             | 3 869 233        | 0,15              |
| 10 000 000 2.440% China Government Bond<br>15/10/2027             | 1 441 926        | 0,05              | 25 000 000 2.600% China Government Bond<br>01/09/2032             | 3 555 884        | 0,14              |
| 10 000 000 3.820% China Government Bond<br>02/11/2027             | 1 546 570        | 0,06              | 23 000 000 2.800% China Government Bond<br>15/11/2032             | 3 326 069        | 0,13              |
| 30 000 000 3.280% China Government Bond<br>03/12/2027             | 4 496 824        | 0,17              | 27 000 000 2.880% China Government Bond<br>25/02/2033             | 3 938 350        | 0,15              |
| 25 000 000 2.640% China Government Bond<br>15/01/2028             | 3 633 228        | 0,14              | 1 150 000 3.740% China Government Bond<br>22/09/2035              | 182 349          | 0,01              |
| 10 000 000 3.850% China Government Bond<br>01/02/2028             | 1 550 339        | 0,06              | 10 000 000 4.080% China Government Bond<br>01/03/2040             | 1 651 928        | 0,06              |
| 25 000 000 3.010% China Government Bond<br>13/05/2028             | 3 694 275        | 0,14              | 6 000 000 4.310% China Government Bond<br>24/02/2041              | 1 027 749        | 0,04              |
| 10 000 000 3.690% China Government Bond<br>17/05/2028             | 1 537 184        | 0,06              | 7 800 000 4.500% China Government Bond<br>23/06/2041              | 1 361 840        | 0,05              |
| 15 000 000 3.540% China Government Bond<br>16/08/2028             | 2 288 882        | 0,09              | 3 000 000 4.760% China Government Bond<br>16/09/2043              | 547 403          | 0,02              |
| 20 000 000 2.910% China Government Bond<br>14/10/2028             | 2 937 346        | 0,11              | 10 000 000 4.760% China Government Bond<br>24/07/2044             | 1 820 994        | 0,07              |
| 20 800 000 3.250% China Government Bond<br>22/11/2028             | 3 122 399        | 0,12              | 10 000 000 4.300% China Government Bond<br>27/10/2044             | 1 703 442        | 0,07              |
| 15 000 000 2.800% China Government Bond<br>24/03/2029             | 2 183 779        | 0,08              | 8 000 000 3.520% China Government Bond<br>25/04/2046              | 1 211 191        | 0,05              |
| 25 000 000 3.290% China Government Bond<br>23/05/2029             | 3 770 346        | 0,14              | 6 330 000 3.270% China Government Bond<br>22/08/2046              | 923 802          | 0,04              |
| 15 000 000 2.750% China Government Bond<br>15/06/2029             | 2 175 288        | 0,08              | 18 000 000 4.050% China Government Bond<br>24/07/2047             | 2 982 717        | 0,11              |
| 15 000 000 2.620% China Government Bond<br>25/09/2029             | 2 156 101        | 0,08              | 10 000 000 4.280% China Government Bond<br>23/10/2047             | 1 716 830        | 0,07              |
| 26 000 000 3.130% China Government Bond<br>21/11/2029             | 3 865 012        | 0,15              | 10 000 000 4.220% China Government Bond<br>19/03/2048             | 1 703 501        | 0,07              |
| 10 000 000 2.790% China Government Bond<br>15/12/2029             | 1 452 331        | 0,06              | 15 000 000 3.970% China Government Bond<br>23/07/2048             | 2 457 635        | 0,09              |
| 15 000 000 2.800% China Government Bond<br>25/03/2030             | 2 178 704        | 0,08              | 25 850 000 4.080% China Government Bond<br>22/10/2048             | 4 303 863        | 0,16              |
| 25 000 000 2.680% China Government Bond<br>21/05/2030             | 3 598 049        | 0,14              | 24 000 000 3.860% China Government Bond<br>22/07/2049             | 3 864 706        | 0,15              |
| 44 000 000 3.270% China Government Bond<br>19/11/2030             | 6 633 247        | 0,25              | 30 000 000 3.390% China Government Bond<br>16/03/2050             | 4 456 966        | 0,17              |
| 10 000 000 4.150% China Government Bond<br>28/04/2031             | 1 621 470        | 0,06              | 25 000 000 3.810% China Government Bond<br>14/09/2050             | 4 000 742        | 0,15              |
| 40 000 000 3.020% China Government Bond<br>27/05/2031             | 5 903 796        | 0,23              | 15 000 000 3.720% China Government Bond<br>12/04/2051             | 2 366 219        | 0,09              |

## SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation | Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation | Investissement  | Juste valeur USD     | % des actifs nets |
|---------------|---|------------------|-------------------|---------------|---|----------------------|-------------------|
|               | <b>Valeurs mobilières – 97,78 % (mars 2022 : 97,42 %) (suite)</b> |                  |                   |               | <b>Valeurs mobilières – 97,78 % (mars 2022 : 97,42 %) (suite)</b> |                      |                   |
|               | <b>Obligations d'État – 97,78 % (mars 2022 : 97,32 %) (suite)</b> |                  |                   |               | <b>Obligations d'État – 97,78 % (mars 2022 : 97,32 %) (suite)</b> |                      |                   |
|               | <b>Yuan Renminbi – 9,80 % (suite)</b>                             |                  |                   |               | <b>Yuan Renminbi – 9,80 % (suite)</b>                             |                      |                   |
| 10 000 000    | 3.530% China Government Bond 18/10/2051                           | 1 529 021        | 0,06              | 35 000 000    | 3.730% China Government Bond 25/05/2070                           | 5 611 633            | 0,21              |
| 2 000 000     | 3.320% China Government Bond 15/04/2052                           | 295 949          | 0,01              | 25 000 000    | 3.400% China Government Bond 15/07/2072                           | 3 730 691            | 0,14              |
| 10 000 000    | 3.120% China Government Bond 25/10/2052                           | 1 425 134        | 0,05              |               |   | <b>256 005 266</b>   | <b>9,80</b>       |
| 24 100 000    | 4.330% China Government Bond 10/11/2061                           | 4 323 400        | 0,17              |               | <b>Total des obligations d'État</b>                               | <b>2 552 940 405</b> | <b>97,78</b>      |
| 15 000 000    | 4.000% China Government Bond 24/06/2069                           | 2 542 023        | 0,10              |               | <b>Total des valeurs mobilières</b>                               | <b>2 552 940 405</b> | <b>97,78</b>      |

Instruments financiers dérivés – 0,20 % (mars 2022 : (0,16 %))

Contrats de change à terme – 0,20 % (mars 2022 : (0,16 %))^

| Devise achetée | Devise vendue | Montant acheté | Montant vendu | Date d'échéance | Contrepartie                | Plus-values/ (Moins-values) latentes USD | % du Comp. |
|----------------|---------------|----------------|---------------|-----------------|-----------------------------|--|------------|
| BRL            | USD           | 10 000 000     | 1 912 726     | 11/04/2023      | Goldman Sachs               | 57 698                                   | 0,00       |
| BRL            | USD           | 63 200 000     | 12 373 354    | 11/04/2023      | UBS AG                      | 79 725                                   | 0,00       |
| COP            | USD           | 9 000 000 000  | 1 855 846     | 11/04/2023      | UBS AG                      | 73 816                                   | 0,00       |
| COP            | USD           | 9 000 000 000  | 1 931 849     | 09/05/2023      | Goldman Sachs               | (14 585)                                 | (0,00)     |
| CZK            | USD           | 100 000 000    | 4 457 222     | 11/04/2023      | Goldman Sachs               | 168 681                                  | 0,01       |
| CZK            | USD           | 50 000 000     | 2 307 018     | 09/05/2023      | BNP Paribas                 | 2 588                                    | 0,00       |
| EUR            | USD           | 286 030        | 308 000       | 05/04/2023      | Barclays Bank               | 2 774                                    | 0,00       |
| EUR            | USD           | 47 295 451     | 50 020 000    | 05/04/2023      | Goldman Sachs               | 1 366 934                                | 0,05       |
| EUR            | USD           | 47 299 834     | 50 020 000    | 05/04/2023      | UBS AG                      | 1 371 697                                | 0,05       |
| EUR            | USD           | 47 304 441     | 50 020 000    | 05/04/2023      | HSBC Bank                   | 1 376 703                                | 0,05       |
| EUR            | USD           | 48 850 347     | 51 666 000    | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | 1 410 343                                | 0,05       |
| EUR            | USD           | 43 038 279     | 46 838 000    | 04/05/2023      | Merrill Lynch International | (348)                                    | (0,00)     |
| EUR            | USD           | 43 041 436     | 46 838 000    | 04/05/2023      | Citibank                    | 3 086                                    | 0,00       |
| EUR            | USD           | 43 995 097     | 47 872 000    | 04/05/2023      | Westpac Banking Corporation | 6 936                                    | 0,00       |
| EUR            | USD           | 43 046 072     | 46 838 000    | 04/05/2023      | HSBC Bank                   | 8 132                                    | 0,00       |
| ILS            | USD           | 4 000 000      | 1 091 685     | 11/04/2023      | Morgan Stanley              | 19 373                                   | 0,00       |
| KRW            | USD           | 4 000 000 000  | 3 044 835     | 11/04/2023      | Barclays Bank               | 28 896                                   | 0,00       |
| KRW            | USD           | 6 000 000 000  | 4 539 608     | 11/04/2023      | HSBC Bank                   | 70 989                                   | 0,00       |
| MXN            | USD           | 100 000 000    | 5 398 644     | 11/04/2023      | Citibank                    | 131 718                                  | 0,01       |
| MXN            | USD           | 100 000 000    | 5 488 775     | 09/05/2023      | Barclays Bank               | 12 110                                   | 0,00       |
| PLN            | USD           | 13 000 000     | 2 900 256     | 11/04/2023      | Barclays Bank               | 116 178                                  | 0,01       |
| PLN            | USD           | 13 000 000     | 3 012 638     | 09/05/2023      | Barclays Bank               | (1 551)                                  | (0,00)     |
| USD            | BRL           | 13 985 869     | 73 200 000    | 11/04/2023      | Goldman Sachs               | (437 634)                                | (0,01)     |
| USD            | BRL           | 12 317 887     | 63 200 000    | 09/05/2023      | UBS AG                      | (73 366)                                 | (0,00)     |
| USD            | COP           | 1 943 005      | 9 000 000 000 | 11/04/2023      | Goldman Sachs               | 13 343                                   | 0,00       |
| USD            | CZK           | 4 543 126      | 100 000 000   | 11/04/2023      | BNP Paribas                 | (82 778)                                 | (0,00)     |
| USD            | EUR           | 54 049 000     | 49 898 778    | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (166 473)                                | (0,01)     |
| USD            | EUR           | 7 211 000      | 6 786 038     | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | (162 091)                                | (0,01)     |
| USD            | EUR           | 46 838 000     | 43 117 003    | 05/04/2023      | HSBC Bank                   | (9 013)                                  | (0,00)     |
| USD            | EUR           | 47 098 000     | 43 352 177    | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | (4 531)                                  | (0,00)     |
| USD            | EUR           | 46 838 000     | 43 112 189    | 05/04/2023      | Citibank                    | (3 782)                                  | (0,00)     |
| USD            | ILS           | 1 091 502      | 4 000 000     | 11/04/2023      | BNP Paribas                 | (19 556)                                 | (0,00)     |
| USD            | KRW           | 4 540 295      | 6 000 000 000 | 11/04/2023      | Citibank                    | (70 302)                                 | (0,00)     |
| USD            | KRW           | 3 045 252      | 4 000 000 000 | 11/04/2023      | Barclays Bank               | (28 479)                                 | (0,00)     |
| USD            | MXN           | 5 518 764      | 100 000 000   | 11/04/2023      | Barclays Bank               | (11 598)                                 | (0,00)     |

## SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

Instruments financiers dérivés – 0,20 % (mars 2022 : (0,16 %)) (suite)

Contrats de change à terme – 0,20 % (mars 2022 : (0,16 %))^ (suite)

| Devise achetée | Devise vendue | Montant acheté | Montant vendu | Date d'échéance | Contrepartie  | Plus-values/<br>(Moins-values)<br>latentes<br>USD | % du<br>Comp. |
|----------------|---------------|----------------|---------------|-----------------|---------------|---|---------------|
| USD            | PLN           | 3 017 817      | 13 000 000    | 11/04/2023      | Barclays Bank | 1 383   | 0,00          |
|                |               |                |               |                 |               | <b>6 323 103</b>                                  | <b>0,23</b>   |
|                |               |                |               |                 |               | <b>(1 086 087)</b>                                | <b>(0,03)</b> |
|                |               |                |               |                 |               | <b>5 237 016</b>                                  | <b>0,20</b>   |
|                |               |                |               |                 |               | <b>5 237 016</b>                                  | <b>0,20</b>   |

|   | Juste valeur<br>USD  | % du<br>Comp. |
|---|----------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | 2 558 177 421        | 97,98         |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 1,60 %)</b>                               | 27 599 459           | 1,06          |
| <b>Liquidités détenues auprès d'un courtier (mars 2022 : 0,15 %)</b>                | -                    | -             |
| <b>Découverts bancaires (mars 2022 : néant)</b>                                     | (3 090 446)          | (0,12)        |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : 0,99 %)</b>                                      | 28 147 672           | 1,08          |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>2 610 834 106</b> | <b>100,00</b> |

^ Des Contrats de change à terme sont utilisés à des fins de couverture.

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                                   | <b>% du<br/>total<br/>des actifs</b> |
|--|--------------------------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs            | 63,89                                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé                        | 25,29                                |
| Autres valeurs mobilières du type mentionné dans le Règlement 68(1)(a), (b) et (c) | 7,00                                 |
| Instruments financiers dérivés négociés de gré à gré                               | 0,24                                 |
| Autres actifs  | 3,58                                 |
| <b>Total des actifs</b>  | <b>100,00</b>                        |



## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>EUR        | 2022<br>EUR         |
|---|-------|--------------------|---------------------|
| <b>Actifs circulants</b>  |       |                    |                     |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :            |       |                    |                     |
|   | 1(e)  |                    |                     |
| Valeurs mobilières  |       | 466 979 214        | 538 834 067         |
|   |       | <b>466 979 214</b> | <b>538 834 067</b>  |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie   |       |                    |                     |
|   | 1(f)  | 591 178            | 867 424             |
| Créances :  |       |                    |                     |
| Intérêts à recevoir   |       | 3 577 236          | 3 523 786           |
| À recevoir sur cessions d'investissements   |       | 5 610 092          | 54 548 971          |
|   |       | <b>476 757 720</b> | <b>597 774 248</b>  |
| <b>Total des actifs circulants</b>  |       |                    |                     |
| <b>Passifs circulants</b>   |       |                    |                     |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :  |       |                    |                     |
| Charges à payer   |       | (67 714)           | (88 898)            |
| À payer sur achats d'investissements  |       | (5 015 721)        | (3 404 543)         |
| À payer sur rachats d'actions de fonds  |       | -                  | (50 957 087)        |
|   |       | <b>(5 083 435)</b> | <b>(54 450 528)</b> |
| <b>Total des passifs circulants</b>   |       |                    |                     |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> |       |                    |                     |
|   |       | <b>471 674 285</b> | <b>543 323 720</b>  |
|   |       | <b>2023</b>        | <b>2022</b>         |
|   |       | <b>2021</b>        |                     |
| Valeur liquidative par action   | 5     | 52,87 EUR          | 59,63 EUR           |
|   |       |                    | 63,97 EUR           |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>EUR         | 2022<br>EUR         |
|---|-------|---------------------|---------------------|
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 4 345 391           | 3 195 006           |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 9     | (60 091 998)        | (47 135 025)        |
| Produits divers   |       | 2 875               | -                   |
| <b>Total des charges d'investissement</b>   |       | <b>(55 743 732)</b> | <b>(43 940 019)</b> |
| Charges opérationnelles   | 3     | (808 838)           | (1 083 052)         |
| <b>Perte nette pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(56 552 570)</b> | <b>(45 023 071)</b> |
| <b>Charges financières</b>  |       |                     |                     |
| Charges d'intérêts  |       | (2 688)             | (13 436)            |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables   | 7     | (2 810 701)         | (2 306 548)         |
| <b>Perte pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(59 365 959)</b> | <b>(47 343 055)</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement   | 2     | (11 049)            | (498)               |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(59 377 008)</b> | <b>(47 343 553)</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>EUR         | 2022<br>EUR         |
|---|---------------------|---------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier               | 543 323 720         | 582 518 566         |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(59 377 008)</b> | <b>(47 343 553)</b> |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                     |                     |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 181 102 209         | 219 284 109         |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (193 374 636)       | (211 135 402)       |
| (Diminution)/Augmentation des actifs nets résultant d'opérations sur actions  | (12 272 427)        | 8 148 707           |
| <b>Diminution totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                   | <b>(71 649 435)</b> | <b>(39 194 846)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>        | <b>471 674 285</b>  | <b>543 323 720</b>  |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

| Notes   | 2023<br>EUR         | 2022<br>EUR         |
|---|---------------------|---------------------|
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(59 377 008)</b> | <b>(47 343 553)</b> |
| <b>Ajustement pour :</b>  |                     |                     |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 122 404 910         | (12 300 402)        |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   | <b>63 027 902</b>   | <b>(59 643 955)</b> |
| Variation des montants à recevoir   | (53 450)            | 269 780             |
| Variation des montants à payer  | (21 184)            | 7 253               |
| <b>(Sorties)/Entrées de trésorerie sur opérations</b>   | <b>(74 634)</b>     | <b>277 033</b>      |
| <b>Entrées/(Sorties) de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  | <b>62 953 268</b>   | <b>(59 366 922)</b> |
| <b>Activités de financement</b>   |                     |                     |
| Produits des souscriptions  | 5 181 102 209       | 219 284 109         |
| Paiements sur rachats   | 5 (244 331 723)     | (160 178 315)       |
| <b>Trésorerie nette (utilisée)/générée sur activités de financement</b>   | <b>(63 229 514)</b> | <b>59 105 794</b>   |
| <b>Diminution nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>   | <b>(276 246)</b>    | <b>(261 128)</b>    |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  | 867 424             | 1 128 552           |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   | <b>591 178</b>      | <b>867 424</b>      |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |                     |                     |
| Impôts payés  | (11 049)            | (498)               |
| Intérêts reçus  | 7 139 605           | 8 591 466           |
| Intérêts payés  | (2 688)             | (13 436)            |
| Distributions payées  | (2 810 701)         | (2 306 548)         |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement   | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %)</b>            |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %)</b>      |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 %</b>  |                  |                   |
| 100 000 1.608% 2i Rete Gas SpA 31/10/2027                            | 90 457           | 0,02              |
| 100 000 1.500% 3M Co 09/11/2026                                      | 92 972           | 0,02              |
| 100 000 1.500% A2A SpA 16/03/2028                                    | 88 964           | 0,02              |
| 200 000 3.125% Aareal Bank AG 13/02/2026                             | 199 168          | 0,04              |
| 100 000 0.050% Aareal Bank AG 02/09/2026                             | 83 945           | 0,02              |
| 100 000 0.500% Aareal Bank AG 07/04/2027                             | 80 196           | 0,02              |
| 100 000 0.010% Aareal Bank AG 01/02/2028                             | 85 925           | 0,02              |
| 100 000 0.750% Abanca Corp Bancaria SA 28/05/2029                    | 85 524           | 0,02              |
| 100 000 0.000% ABB Finance BV 19/01/2030                             | 79 708           | 0,02              |
| 100 000 0.375% Abbott Ireland Financing DAC 19/11/2027               | 87 669           | 0,02              |
| 100 000 2.625% AbbVie Inc 15/11/2028                                 | 94 534           | 0,02              |
| 100 000 2.125% AbbVie Inc 01/06/2029                                 | 91 632           | 0,02              |
| 100 000 0.625% Abertis Infraestructuras SA 15/07/2025                | 93 525           | 0,02              |
| 100 000 2.375% Abertis Infraestructuras SA 27/09/2027                | 93 465           | 0,02              |
| 100 000 1.625% Abertis Infraestructuras SA 15/07/2029                | 86 288           | 0,02              |
| 200 000 0.875% ABN AMRO Bank NV 14/01/2026                           | 187 460          | 0,04              |
| 100 000 0.500% ABN AMRO Bank NV 15/04/2026                           | 90 543           | 0,02              |
| 100 000 2.375% ABN AMRO Bank NV 01/06/2027                           | 93 662           | 0,02              |
| 100 000 4.000% ABN AMRO Bank NV 16/01/2028                           | 99 307           | 0,02              |
| 100 000 1.500% ABN AMRO Bank NV 30/09/2030                           | 89 334           | 0,02              |
| 100 000 1.000% ABN AMRO Bank NV 13/04/2031                           | 85 155           | 0,02              |
| 100 000 3.000% ABN AMRO Bank NV 01/06/2032                           | 92 473           | 0,02              |
| 100 000 1.250% ABN AMRO Bank NV 10/01/2033                           | 84 040           | 0,02              |
| 100 000 1.000% ABN AMRO Bank NV 02/06/2033                           | 76 048           | 0,01              |
| 100 000 1.375% ABN AMRO Bank NV 10/01/2034                           | 83 619           | 0,02              |
| 100 000 0.375% ABN AMRO Bank NV 14/01/2035                           | 72 485           | 0,01              |
| 100 000 1.125% ABN AMRO Bank NV 23/04/2039                           | 73 309           | 0,01              |
| 100 000 0.400% ABN AMRO Bank NV 17/09/2041                           | 60 129           | 0,01              |
| 100 000 0.375% Acciona Energia Financiacion Filiales SA 07/10/2027   | 87 031           | 0,02              |
| 100 000 1.000% ACEA SpA 24/10/2026                                   | 91 423           | 0,02              |
| 100 000 0.500% Achmea Bank NV 20/02/2026                             | 92 126           | 0,02              |
| 200 000 0.125% Adecco International Financial Services BV 21/09/2028 | 163 106          | 0,03              |
| 100 000 0.000% adidas AG 09/09/2024                                  | 95 430           | 0,02              |
| 100 000 0.010% Aegon Bank NV 16/11/2025                              | 91 560           | 0,02              |
| 100 000 0.375% Aegon Bank NV 21/11/2056                              | 95 078           | 0,02              |
| 100 000 1.625% Aeroporti di Roma SpA 08/06/2027                      | 93 393           | 0,02              |
| 100 000 1.000% Aeroports de Paris 05/01/2029                         | 86 129           | 0,02              |
| 200 000 2.750% Aeroports de Paris 02/04/2030                         | 187 524          | 0,04              |

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 50 000 0.125% African Development Bank 07/10/2026                       | 45 108           | 0,01              |
| 100 000 0.500% African Development Bank 21/03/2029                      | 86 365           | 0,02              |
| 100 000 1.875% Ageas SA/NV 24/11/2051                                   | 71 558           | 0,01              |
| 100 000 3.625% AIB Group PLC 04/07/2026                                 | 98 180           | 0,02              |
| 100 000 2.250% AIB Group PLC 04/04/2028                                 | 90 749           | 0,02              |
| 100 000 1.375% Air Liquide Finance SA 02/04/2030                        | 89 138           | 0,02              |
| 200 000 0.375% Air Liquide Finance SA 20/09/2033                        | 149 008          | 0,03              |
| 100 000 0.500% Air Products and Chemicals Inc 05/05/2028                | 85 457           | 0,02              |
| 100 000 1.375% Airbus SE 09/06/2026                                     | 93 889           | 0,02              |
| 100 000 1.625% Airbus SE 09/06/2030                                     | 87 859           | 0,02              |
| 100 000 2.375% Airbus SE 07/04/2032                                     | 90 430           | 0,02              |
| 100 000 1.750% Akelius Residential Property AB 07/02/2025               | 93 150           | 0,02              |
| 100 000 1.000% Akelius Residential Property Financing BV 17/01/2028     | 80 419           | 0,02              |
| 100 000 0.375% Aktia Bank Oyj 05/03/2026                                | 91 952           | 0,02              |
| 100 000 1.625% Akzo Nobel NV 14/04/2030                                 | 85 982           | 0,02              |
| 100 000 1.625% Albemarle New Holding GmbH 25/11/2028                    | 87 856           | 0,02              |
| 100 000 1.250% ALD SA 02/03/2026  | 92 292           | 0,02              |
| 100 000 0.875% Alfa Laval Treasury International AB 18/02/2026          | 91 652           | 0,02              |
| 100 000 2.625% Alliander NV 09/09/2027                                  | 97 321           | 0,02              |
| 100 000 0.000% Allianz Finance II BV 14/01/2025                         | 94 428           | 0,02              |
| 100 000 0.875% Allianz Finance II BV 15/01/2026                         | 93 991           | 0,02              |
| 100 000 0.000% Allianz Finance II BV 22/11/2026                         | 89 679           | 0,02              |
| 100 000 4.597% Allianz SE 07/09/2038                                    | 97 531           | 0,02              |
| 100 000 4.252% Allianz SE 05/07/2052                                    | 92 027           | 0,02              |
| 100 000 3.375% Allianz SE (Perpetual)                                   | 97 552           | 0,02              |
| 100 000 0.250% Alstom SA 14/10/2026                                     | 90 280           | 0,02              |
| 100 000 1.500% alstria office REIT-AG 15/11/2027                        | 71 799           | 0,01              |
| 100 000 2.200% Altria Group Inc 15/06/2027                              | 91 962           | 0,02              |
| 100 000 2.250% AMCO - Asset Management Co SpA 17/07/2027                | 91 069           | 0,02              |
| 100 000 2.125% America Movil SAB de CV 10/03/2028                       | 92 247           | 0,02              |
| 100 000 0.300% American Honda Finance Corp 07/07/2028                   | 84 143           | 0,02              |
| 100 000 1.875% American International Group Inc 21/06/2027              | 91 375           | 0,02              |
| 100 000 0.750% American Medical Systems Europe BV 08/03/2025            | 94 665           | 0,02              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 100 000 1.625% American Medical Systems Europe BV 08/03/2031            | 85 765              | 0,02                    |
| 100 000 0.450% American Tower Corp 15/01/2027                           | 87 319              | 0,02                    |
| 100 000 1.000% American Tower Corp 15/01/2032                           | 73 841              | 0,01                    |
| 100 000 3.971% Amprion GmbH 22/09/2032                                  | 101 758             | 0,02                    |
| 100 000 5.000% Anglo American Capital PLC 15/03/2031                    | 102 670             | 0,02                    |
| 100 000 4.750% Anglo American Capital PLC 21/09/2032                    | 100 680             | 0,02                    |
| 200 000 2.700% Anheuser-Busch InBev SA/NV 31/03/2026                    | 195 676             | 0,04                    |
| 100 000 1.125% Anheuser-Busch InBev SA/NV 01/07/2027                    | 91 363              | 0,02                    |
| 100 000 2.000% Anheuser-Busch InBev SA/NV 17/03/2028                    | 94 441              | 0,02                    |
| 69 000 1.500% Anheuser-Busch InBev SA/NV 18/04/2030                     | 61 312              | 0,01                    |
| 100 000 2.875% Anheuser-Busch InBev SA/NV 02/04/2032                    | 94 581              | 0,02                    |
| 100 000 2.000% Anheuser-Busch InBev SA/NV 23/01/2035                    | 83 010              | 0,02                    |
| 100 000 2.750% Anheuser-Busch InBev SA/NV 17/03/2036                    | 89 404              | 0,02                    |
| 100 000 0.200% ANZ New Zealand Int'l Ltd/ London 23/09/2027             | 84 814              | 0,02                    |
| 100 000 0.750% AP Moller - Maersk A/S 25/11/2031                        | 76 923              | 0,01                    |
| 100 000 2.000% APA Infrastructure Ltd 22/03/2027                        | 91 922              | 0,02                    |
| 100 000 0.875% Apple Inc 24/05/2025                                     | 95 503              | 0,02                    |
| 100 000 0.000% Apple Inc 15/11/2025                                     | 92 368              | 0,02                    |
| 100 000 1.375% Apple Inc 24/05/2029                                     | 90 246              | 0,02                    |
| 100 000 1.250% APRR SA 18/01/2028                                       | 90 490              | 0,02                    |
| 100 000 0.125% APRR SA 18/01/2029                                       | 82 830              | 0,02                    |
| 100 000 4.875% ArcelorMittal SA 26/09/2026                              | 102 027             | 0,02                    |
| 100 000 1.375% Argenta Spaarbank NV 08/02/2029                          | 81 186              | 0,02                    |
| 200 000 2.000% Argentum Netherlands BV for Givaudan SA 17/09/2030       | 177 392             | 0,04                    |
| 100 000 2.750% Arkea Home Loans SFH SA 22/12/2026                       | 98 069              | 0,02                    |
| 100 000 3.000% Arkea Home Loans SFH SA 04/10/2028                       | 99 075              | 0,02                    |
| 100 000 0.125% Arkea Home Loans SFH SA 12/07/2029                       | 82 893              | 0,02                    |
| 100 000 1.500% Arkea Home Loans SFH SA 01/06/2033                       | 84 906              | 0,02                    |
| 100 000 0.125% Arkema SA 14/10/2026                                     | 89 626              | 0,02                    |
| 200 000 0.000% Arountown SA 16/07/2026                                  | 141 568             | 0,03                    |
| 100 000 3.375% Arountown SA (Perpetual)                                 | 44 671              | 0,01                    |

| Participation Investissement   | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|--|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>          |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b>    |                     |                         |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>  |                     |                         |
| 100 000 4.000% Arval Service Lease SA/France 22/09/2026                    | 99 067              | 0,02                    |
| 100 000 0.336% Asahi Group Holdings Ltd 19/04/2027                         | 87 290              | 0,02                    |
| 100 000 0.541% Asahi Group Holdings Ltd 23/10/2028                         | 83 736              | 0,02                    |
| 100 000 0.250% ASB Finance Ltd 08/09/2028                                  | 82 801              | 0,02                    |
| 100 000 0.500% ASB Finance Ltd 24/09/2029                                  | 80 546              | 0,02                    |
| 100 000 0.000% Asian Development Bank 24/10/2029                           | 82 691              | 0,02                    |
| 100 000 0.025% Asian Development Bank 31/01/2030                           | 82 008              | 0,02                    |
| 50 000 1.400% Asian Development Bank 06/02/2037                            | 40 451              | 0,01                    |
| 100 000 1.375% ASML Holding NV 07/07/2026                                  | 94 487              | 0,02                    |
| 200 000 5.125% ASR Nederland NV 29/09/2045                                 | 196 402             | 0,04                    |
| 200 000 3.875% Assicurazioni Generali SpA 29/01/2029                       | 186 898             | 0,04                    |
| 100 000 5.500% Assicurazioni Generali SpA 27/10/2047                       | 99 837              | 0,02                    |
| 100 000 5.000% Assicurazioni Generali SpA 08/06/2048                       | 98 198              | 0,02                    |
| 100 000 1.500% ASTM SpA 25/01/2030   | 80 454              | 0,02                    |
| 100 000 2.375% ASTM SpA 25/11/2033   | 77 573              | 0,02                    |
| 100 000 0.375% AstraZeneca PLC 03/06/2029                                  | 83 417              | 0,02                    |
| 100 000 3.500% AT&T Inc 17/12/2025   | 99 859              | 0,02                    |
| 100 000 1.600% AT&T Inc 19/05/2028   | 90 176              | 0,02                    |
| 200 000 3.150% AT&T Inc 04/09/2036   | 176 932             | 0,04                    |
| 100 000 2.600% AT&T Inc 19/05/2038   | 80 936              | 0,02                    |
| 100 000 1.800% AT&T Inc 14/09/2039   | 70 183              | 0,01                    |
| 100 000 0.366% Athene Global Funding 10/09/2026                            | 84 458              | 0,02                    |
| 100 000 3.125% Aurizon Network Pty Ltd 01/06/2026                          | 96 575              | 0,02                    |
| 100 000 0.250% Australia & New Zealand Banking Group Ltd 17/03/2025        | 93 881              | 0,02                    |
| 100 000 5.101% Australia & New Zealand Banking Group Ltd 03/02/2033        | 100 099             | 0,02                    |
| 200 000 2.750% Autobahnen- und Schnellstrassen-Finanzierungs AG 11/06/2032 | 196 050             | 0,04                    |
| 100 000 1.250% Autoroutes du Sud de la France SA 18/01/2027                | 92 593              | 0,02                    |
| 100 000 2.750% Autoroutes du Sud de la France SA 02/09/2032                | 92 807              | 0,02                    |
| 100 000 1.875% Autostrade per l'Italia SpA 04/11/2025                      | 94 232              | 0,02                    |
| 100 000 1.625% Autostrade per l'Italia SpA 25/01/2028                      | 87 087              | 0,02                    |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>              |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b>        |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 4.750% Autostrade per l'Italia SpA 24/01/2031                          | 98 722           | 0,02              |
| 100 000 0.010% AXA Bank Europe SCF 22/01/2027                                  | 88 315           | 0,02              |
| 100 000 0.750% AXA Bank Europe SCF 06/03/2029                                  | 86 799           | 0,02              |
| 100 000 1.375% AXA Bank Europe SCF 18/04/2033                                  | 84 055           | 0,02              |
| 100 000 0.125% AXA Home Loan SFH SA 25/06/2035                                 | 68 454           | 0,01              |
| 100 000 3.750% AXA SA 12/10/2030   | 100 582          | 0,02              |
| 100 000 3.375% AXA SA 06/07/2047   | 93 198           | 0,02              |
| 100 000 3.941% AXA SA (Perpetual)  | 97 023           | 0,02              |
| 100 000 3.750% AyT Cédulas Cajas X Fondo de Titulización de Activos 30/06/2025 | 100 007          | 0,02              |
| 100 000 1.000% Balder Finland Oyj 18/01/2027                                   | 76 516           | 0,01              |
| 100 000 1.000% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 21/06/2026                   | 91 943           | 0,02              |
| 200 000 0.875% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 22/11/2026                   | 183 210          | 0,04              |
| 100 000 0.500% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 14/01/2027                   | 87 702           | 0,02              |
| 200 000 3.500% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 10/02/2027                   | 194 202          | 0,04              |
| 100 000 0.125% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 24/03/2027                   | 89 673           | 0,02              |
| 100 000 4.375% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 14/10/2029                   | 102 672          | 0,02              |
| 100 000 1.000% Banco BPM SpA 23/01/2025  | 95 426           | 0,02              |
| 200 000 0.625% Banco de Sabadell SA 10/06/2024                                 | 193 088          | 0,04              |
| 200 000 0.125% Banco de Sabadell SA 10/02/2028                                 | 170 838          | 0,03              |
| 200 000 1.125% Banco Santander SA 27/11/2024                                   | 192 418          | 0,04              |
| 100 000 0.010% Banco Santander SA 27/02/2025                                   | 93 589           | 0,02              |
| 100 000 3.375% Banco Santander SA 11/01/2026                                   | 99 820           | 0,02              |
| 100 000 1.500% Banco Santander SA 25/01/2026                                   | 94 856           | 0,02              |
| 100 000 3.250% Banco Santander SA 04/04/2026                                   | 97 017           | 0,02              |
| 100 000 3.625% Banco Santander SA 27/09/2026                                   | 99 167           | 0,02              |
| 200 000 0.300% Banco Santander SA 04/10/2026                                   | 178 874          | 0,04              |
| 100 000 0.500% Banco Santander SA 24/03/2027                                   | 89 406           | 0,02              |
| 100 000 1.125% Banco Santander SA 23/06/2027                                   | 89 422           | 0,02              |
| 200 000 2.125% Banco Santander SA 08/02/2028                                   | 179 370          | 0,04              |
| 100 000 0.200% Banco Santander SA 11/02/2028                                   | 84 147           | 0,02              |
| 100 000 1.125% Banco Santander SA 25/10/2028                                   | 89 265           | 0,02              |
| 100 000 3.375% Banco Santander SA 11/01/2030                                   | 99 824           | 0,02              |
| 100 000 0.875% Banco Santander SA 09/05/2031                                   | 82 247           | 0,02              |
| 100 000 2.000% Banco Santander SA 27/11/2034                                   | 86 113           | 0,02              |

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 0.875% Banco Santander Totta SA 25/04/2024                      | 97 138           | 0,02              |
| 100 000 0.808% Bank of America Corp 09/05/2026                          | 93 430           | 0,02              |
| 100 000 1.776% Bank of America Corp 04/05/2027                          | 93 145           | 0,02              |
| 100 000 1.662% Bank of America Corp 25/04/2028                          | 90 449           | 0,02              |
| 100 000 0.580% Bank of America Corp 08/08/2029                          | 82 937           | 0,02              |
| 100 000 0.654% Bank of America Corp 26/10/2031                          | 77 634           | 0,02              |
| 100 000 1.102% Bank of America Corp 24/05/2032                          | 78 668           | 0,02              |
| 100 000 2.824% Bank of America Corp 27/04/2033                          | 89 352           | 0,02              |
| 100 000 1.875% Bank of Ireland Group PLC 05/06/2026                     | 94 734           | 0,02              |
| 100 000 0.625% Bank of Ireland Mortgage Bank 14/03/2025                 | 94 710           | 0,02              |
| 200 000 0.125% Bank of Montreal 26/01/2027                              | 176 750          | 0,04              |
| 100 000 2.750% Bank of Montreal 15/06/2027                              | 95 763           | 0,02              |
| 200 000 3.050% Bank of Nova Scotia 31/10/2024                           | 198 528          | 0,04              |
| 100 000 0.500% Bank of Nova Scotia 22/01/2025                           | 94 772           | 0,02              |
| 100 000 0.010% Bank of Nova Scotia 18/03/2025                           | 93 381           | 0,02              |
| 100 000 0.010% Bank of Nova Scotia 14/01/2027                           | 88 010           | 0,02              |
| 100 000 0.010% Bank of Nova Scotia 15/12/2027                           | 85 630           | 0,02              |
| 200 000 0.250% Bank of Nova Scotia 01/11/2028                           | 163 014          | 0,03              |
| 100 000 0.125% Bank of Queensland Ltd 04/06/2024                        | 95 984           | 0,02              |
| 100 000 0.875% Bankinter SA 08/07/2026                                  | 89 858           | 0,02              |
| 100 000 1.250% Bankinter SA 23/12/2032                                  | 81 341           | 0,02              |
| 100 000 1.250% Banque Federative du Credit Mutuel SA 14/01/2025         | 95 566           | 0,02              |
| 100 000 1.000% Banque Federative du Credit Mutuel SA 23/05/2025         | 94 592           | 0,02              |
| 200 000 0.750% Banque Federative du Credit Mutuel SA 17/07/2025         | 186 462          | 0,04              |
| 100 000 2.375% Banque Federative du Credit Mutuel SA 24/03/2026         | 94 810           | 0,02              |
| 100 000 0.750% Banque Federative du Credit Mutuel SA 08/06/2026         | 91 056           | 0,02              |
| 100 000 1.250% Banque Federative du Credit Mutuel SA 26/05/2027         | 90 396           | 0,02              |
| 100 000 0.625% Banque Federative du Credit Mutuel SA 19/11/2027         | 85 377           | 0,02              |
| 100 000 3.875% Banque Federative du Credit Mutuel SA 26/01/2028         | 98 411           | 0,02              |
| 100 000 0.625% Banque Federative du Credit Mutuel SA 03/11/2028         | 82 636           | 0,02              |
| 100 000 1.875% Banque Federative du Credit Mutuel SA 18/06/2029         | 85 373           | 0,02              |
| 100 000 2.625% Banque Federative du Credit Mutuel SA 06/11/2029         | 91 190           | 0,02              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>   |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b>                                   |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 4.000% Banque Federative du Credit Mutuel SA 21/11/2029   | 102 079          | 0,02              |
| 100 000 0.625% Banque Federative du Credit Mutuel SA 21/02/2031   | 76 720           | 0,01              |
| 100 000 3.875% Banque Federative du Credit Mutuel SA 16/06/2032   | 96 025           | 0,02              |
| 100 000 4.000% Banque Federative du Credit Mutuel SA 26/01/2033   | 97 717           | 0,02              |
| 100 000 3.375% Barclays PLC 02/04/2025  | 99 161           | 0,02              |
| 100 000 0.750% Barclays PLC 09/06/2025  | 95 967           | 0,02              |
| 200 000 0.577% Barclays PLC 09/08/2029  | 159 540          | 0,03              |
| 100 000 1.106% Barclays PLC 12/05/2032  | 74 552           | 0,01              |
| 100 000 5.262% Barclays PLC 29/01/2034  | 101 869          | 0,02              |
| 100 000 0.875% BASF SE 15/11/2027   | 92 239           | 0,02              |
| 100 000 3.125% BASF SE 29/06/2028   | 98 556           | 0,02              |
| 100 000 1.500% BASF SE 17/03/2031   | 86 917           | 0,02              |
| 100 000 3.750% BASF SE 29/06/2032   | 100 568          | 0,02              |
| 100 000 1.250% BAT International Finance PLC 13/03/2027   | 89 154           | 0,02              |
| 100 000 3.125% BAT Netherlands Finance BV 07/04/2028  | 93 653           | 0,02              |
| 100 000 0.200% Bausparkasse Schwaebisch Hall AG 28/10/2031  | 78 549           | 0,02              |
| 100 000 0.200% Bausparkasse Schwaebisch Hall AG 27/04/2033  | 75 096           | 0,01              |
| 100 000 3.125% BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 12/01/2029 | 99 116           | 0,02              |
| 200 000 0.010% BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 03/09/2029 | 162 878          | 0,03              |
| 100 000 0.010% BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 23/09/2030 | 78 689           | 0,02              |
| 100 000 0.400% Baxter International Inc 15/05/2024  | 96 222           | 0,02              |
| 100 000 0.750% Bayer AG 06/01/2027  | 89 537           | 0,02              |
| 100 000 0.375% Bayer AG 12/01/2029  | 81 912           | 0,02              |
| 100 000 1.500% Bayer Capital Corp BV 26/06/2026   | 93 348           | 0,02              |
| 200 000 2.125% Bayer Capital Corp BV 15/12/2029   | 179 070          | 0,04              |
| 100 000 0.500% Bayerische Landesbank 19/03/2025   | 94 613           | 0,02              |
| 100 000 0.750% Bayerische Landesbank 19/01/2028   | 89 720           | 0,02              |
| 100 000 2.125% Bayerische Landesbank 01/09/2031   | 93 507           | 0,02              |
| 100 000 1.000% Bayerische Landesbank 23/09/2031   | 83 082           | 0,02              |

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>           |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b>     |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 1.375% Bayerische Landesbank 22/11/2032                             | 79 601           | 0,02              |
| 100 000 0.250% Bayerische Landesbodenkreditanstalt 21/03/2036               | 69 789           | 0,01              |
| 100 000 1.900% Becton Dickinson and Co 15/12/2026                           | 94 188           | 0,02              |
| 100 000 0.334% Becton Dickinson Euro Finance Sarl 13/08/2028                | 84 080           | 0,02              |
| 100 000 0.750% Belfius Bank SA 10/02/2025                                   | 95 142           | 0,02              |
| 200 000 0.375% Belfius Bank SA 02/09/2025                                   | 183 646          | 0,04              |
| 100 000 1.500% Berkshire Hathaway Finance Corp 18/03/2030                   | 87 987           | 0,02              |
| 100 000 2.150% Berkshire Hathaway Inc 15/03/2028                            | 93 421           | 0,02              |
| 100 000 1.625% Berkshire Hathaway Inc 16/03/2035                            | 79 169           | 0,02              |
| 79 000 0.375% Berlin Hyp AG 03/05/2024                                      | 76 443           | 0,01              |
| 50 000 0.375% Berlin Hyp AG 21/02/2025                                      | 47 288           | 0,01              |
| 200 000 1.000% Berlin Hyp AG 05/02/2026                                     | 183 682          | 0,04              |
| 100 000 0.010% Berlin Hyp AG 07/07/2028                                     | 85 358           | 0,02              |
| 100 000 0.375% Berlin Hyp AG 29/05/2029                                     | 85 112           | 0,02              |
| 100 000 0.250% Berlin Hyp AG 19/05/2033                                     | 75 602           | 0,01              |
| 100 000 2.000% Bertelsmann SE & Co KGaA 01/04/2028                          | 92 859           | 0,02              |
| 100 000 3.500% Bertelsmann SE & Co KGaA 29/05/2029                          | 98 553           | 0,02              |
| 100 000 1.500% Bevco Lux Sarl 16/09/2027                                    | 89 209           | 0,02              |
| 100 000 3.125% BHP Billiton Finance Ltd 29/04/2033                          | 92 307           | 0,02              |
| 100 000 3.625% Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 29/10/2029 | 81 903           | 0,02              |
| 50 000 0.750% BMW Finance NV 15/04/2024                                     | 48 842           | 0,01              |
| 200 000 0.875% BMW Finance NV 03/04/2025                                    | 192 068          | 0,04              |
| 50 000 0.000% BMW Finance NV 11/01/2026                                     | 46 024           | 0,01              |
| 100 000 0.375% BMW Finance NV 14/01/2027                                    | 90 541           | 0,02              |
| 130 000 1.000% BMW Finance NV 22/05/2028                                    | 116 437          | 0,02              |
| 40 000 0.875% BMW Finance NV 14/01/2032                                     | 32 630           | 0,01              |
| 200 000 0.875% BNP Paribas Fortis SA 22/03/2028                             | 178 864          | 0,04              |
| 100 000 0.875% BNP Paribas Home Loan SFH SA 14/11/2024                      | 96 027           | 0,02              |
| 125 000 1.000% BNP Paribas SA 17/04/2024                                    | 121 552          | 0,02              |
| 100 000 1.000% BNP Paribas SA 27/06/2024                                    | 96 666           | 0,02              |
| 100 000 1.500% BNP Paribas SA 17/11/2025                                    | 95 379           | 0,02              |
| 100 000 1.625% BNP Paribas SA 23/02/2026                                    | 95 207           | 0,02              |
| 100 000 0.500% BNP Paribas SA 04/06/2026                                    | 92 852           | 0,02              |
| 200 000 1.125% BNP Paribas SA 11/06/2026                                    | 184 154          | 0,04              |



## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>                    |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b>              |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 2.875% BNP Paribas SA 01/10/2026                                | 96 339           | 0,02              | 200 000 0.010% BPCE SFH SA 16/10/2028  | 167 858          | 0,03              |
| 100 000 0.250% BNP Paribas SA 13/04/2027                                | 88 370           | 0,02              | 100 000 0.010% BPCE SFH SA 29/01/2029  | 83 146           | 0,02              |
| 100 000 0.375% BNP Paribas SA 14/10/2027                                | 87 592           | 0,02              | 100 000 1.000% BPCE SFH SA 08/06/2029  | 87 725           | 0,02              |
| 100 000 0.500% BNP Paribas SA 19/02/2028                                | 86 231           | 0,02              | 100 000 3.000% BPCE SFH SA 17/10/2029  | 98 787           | 0,02              |
| 200 000 1.125% BNP Paribas SA 17/04/2029                                | 171 258          | 0,03              | 100 000 0.010% BPCE SFH SA 27/05/2030  | 79 707           | 0,02              |
| 100 000 1.375% BNP Paribas SA 28/05/2029                                | 84 486           | 0,02              | 100 000 0.125% BPCE SFH SA 03/12/2030  | 79 219           | 0,02              |
| 100 000 3.625% BNP Paribas SA 01/09/2029                                | 96 818           | 0,02              | 100 000 3.125% BPCE SFH SA 20/01/2033  | 98 603           | 0,02              |
| 100 000 0.500% BNP Paribas SA 19/01/2030                                | 80 253           | 0,02              | 100 000 1.375% Bright Food Singapore Holdings Pte Ltd 19/06/2024                     | 95 350           | 0,02              |
| 100 000 0.875% BNP Paribas SA 11/07/2030                                | 81 069           | 0,02              | 100 000 0.500% British Telecommunications PLC 12/09/2025                             | 93 096           | 0,02              |
| 100 000 1.625% BNP Paribas SA 02/07/2031                                | 79 498           | 0,02              | 100 000 1.750% British Telecommunications PLC 10/03/2026                             | 94 886           | 0,02              |
| 100 000 1.125% BNP Paribas SA 15/01/2032                                | 85 671           | 0,02              | 100 000 2.125% British Telecommunications PLC 26/09/2028                             | 92 153           | 0,02              |
| 100 000 0.875% BNP Paribas SA 31/08/2033                                | 79 564           | 0,02              | 100 000 0.625% Cadent Finance PLC 22/09/2024   | 95 783           | 0,02              |
| 100 000 0.500% BNZ International Funding Ltd/ London 03/07/2024         | 96 206           | 0,02              | 200 000 2.750% Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 25/11/2032                 | 194 756          | 0,04              |
| 100 000 0.100% Booking Holdings Inc 08/03/2025                          | 93 671           | 0,02              | 100 000 2.400% Caisse de Refinancement de l'Habitat SA 17/01/2025                    | 98 260           | 0,02              |
| 100 000 1.800% Booking Holdings Inc 03/03/2027                          | 93 696           | 0,02              | 100 000 0.010% Caisse de Refinancement de l'Habitat SA 27/11/2026                    | 89 168           | 0,02              |
| 100 000 4.500% Booking Holdings Inc 15/11/2031                          | 104 021          | 0,02              | 200 000 0.125% Caisse de Refinancement de l'Habitat SA 30/04/2027                    | 176 626          | 0,04              |
| 100 000 1.375% Bouygues SA 07/06/2027                                   | 92 924           | 0,02              | 100 000 0.010% Caisse de Refinancement de l'Habitat SA 08/10/2029                    | 81 650           | 0,02              |
| 100 000 4.625% Bouygues SA 07/06/2032                                   | 105 880          | 0,02              | 100 000 3.000% Caisse de Refinancement de l'Habitat SA 11/01/2030                    | 98 749           | 0,02              |
| 100 000 1.467% BP Capital Markets BV 21/09/2041                         | 64 921           | 0,01              | 100 000 0.250% Caisse de Refinancement de l'Habitat SA 07/02/2035                    | 70 742           | 0,01              |
| 200 000 1.876% BP Capital Markets PLC 07/04/2024                        | 196 976          | 0,04              | 100 000 6.000% Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 23/01/2027 | 102 670          | 0,02              |
| 100 000 1.953% BP Capital Markets PLC 03/03/2025                        | 97 550           | 0,02              | 100 000 0.375% CaixaBank SA 03/02/2025   | 94 220           | 0,02              |
| 100 000 1.637% BP Capital Markets PLC 26/06/2029                        | 89 523           | 0,02              | 100 000 0.625% CaixaBank SA 27/03/2025   | 94 382           | 0,02              |
| 100 000 3.250% BP Capital Markets PLC (Perpetual)                       | 92 381           | 0,02              | 100 000 1.000% CaixaBank SA 25/09/2025   | 93 985           | 0,02              |
| 100 000 3.625% BP Capital Markets PLC (Perpetual)                       | 87 126           | 0,02              | 100 000 1.125% CaixaBank SA 27/03/2026   | 92 787           | 0,02              |
| 100 000 1.000% BPCE SA 01/04/2025                                       | 94 537           | 0,02              | 100 000 1.375% CaixaBank SA 19/06/2026   | 91 948           | 0,02              |
| 200 000 1.375% BPCE SA 23/03/2026                                       | 185 716          | 0,04              | 100 000 0.750% CaixaBank SA 09/07/2026   | 90 789           | 0,02              |
| 100 000 2.875% BPCE SA 22/04/2026                                       | 96 365           | 0,02              | 100 000 0.750% CaixaBank SA 10/07/2026   | 93 247           | 0,02              |
| 100 000 0.010% BPCE SA 14/01/2027                                       | 86 613           | 0,02              | 100 000 0.375% CaixaBank SA 18/11/2026   | 90 075           | 0,02              |
| 200 000 1.750% BPCE SA 26/04/2027                                       | 184 992          | 0,04              | 200 000 1.000% CaixaBank SA 17/01/2028   | 179 346          | 0,04              |
| 200 000 0.500% BPCE SA 15/09/2027                                       | 175 198          | 0,04              | 200 000 2.250% CaixaBank SA 17/04/2030   | 185 724          | 0,04              |
| 100 000 0.500% BPCE SA 14/01/2028                                       | 86 436           | 0,02              | 100 000 0.375% Canadian Imperial Bank of Commerce 03/05/2024                         | 96 308           | 0,02              |
| 100 000 1.000% BPCE SA 05/10/2028                                       | 86 245           | 0,02              | 100 000 0.375% Canadian Imperial Bank of Commerce 10/03/2026                         | 91 367           | 0,02              |
| 200 000 2.375% BPCE SA 26/04/2032                                       | 177 190          | 0,04              | 100 000 0.010% Canadian Imperial Bank of Commerce 30/04/2029                         | 82 062           | 0,02              |
| 100 000 1.000% BPCE SFH SA 24/02/2025                                   | 95 610           | 0,02              |  |                  |                   |
| 100 000 0.010% BPCE SFH SA 08/11/2026                                   | 89 104           | 0,02              |  |                  |                   |
| 100 000 0.750% BPCE SFH SA 27/11/2026                                   | 91 394           | 0,02              |  |                  |                   |
| 200 000 0.625% BPCE SFH SA 22/09/2027                                   | 178 476          | 0,04              |  |                  |                   |
| 100 000 0.010% BPCE SFH SA 10/11/2027                                   | 86 349           | 0,02              |  |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>        |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 1.680% Canal de Isabel II Gestion SA 26/02/2025                  | 96 243           | 0,02              |
| 100 000 1.625% Capgemini SE 15/04/2026                                   | 94 181           | 0,02              |
| 100 000 2.000% Capgemini SE 15/04/2029                                   | 90 660           | 0,02              |
| 100 000 1.650% Capital One Financial Corp 12/06/2029                     | 77 643           | 0,02              |
| 100 000 0.375% Carlsberg Breweries AS 30/06/2027                         | 87 541           | 0,02              |
| 100 000 1.625% Carmila SA 30/05/2027                                     | 85 105           | 0,02              |
| 100 000 0.750% Carrefour SA 26/04/2024                                   | 97 169           | 0,02              |
| 100 000 2.375% Carrefour SA 30/10/2029                                   | 91 395           | 0,02              |
| 100 000 0.875% Castellum Helsinki Finance Holding Abp 17/09/2029         | 65 537           | 0,01              |
| 100 000 0.000% CCEP Finance Ireland DAC 06/09/2025                       | 91 636           | 0,02              |
| 100 000 3.875% Cedulas TDA 6 Fondo de Titulizacion de Activos 23/05/2025 | 100 383          | 0,02              |
| 100 000 4.777% Celanese US Holdings LLC 19/07/2026                       | 98 361           | 0,02              |
| 100 000 2.375% CEZ AS 06/04/2027   | 92 065           | 0,02              |
| 100 000 2.706% Channel Link Enterprises Finance PLC 30/06/2050           | 91 005           | 0,02              |
| 100 000 0.000% China Construction Bank Europe SA 28/06/2024              | 94 724           | 0,02              |
| 100 000 1.550% Chubb INA Holdings Inc 15/03/2028                         | 90 523           | 0,02              |
| 100 000 0.875% Chubb INA Holdings Inc 15/12/2029                         | 82 819           | 0,02              |
| 100 000 0.050% Cie de Financement Foncier SA 16/04/2024                  | 96 598           | 0,02              |
| 100 000 0.500% Cie de Financement Foncier SA 04/09/2024                  | 95 953           | 0,02              |
| 200 000 4.000% Cie de Financement Foncier SA 24/10/2025                  | 203 064          | 0,04              |
| 100 000 0.375% Cie de Financement Foncier SA 09/04/2027                  | 89 303           | 0,02              |
| 100 000 0.750% Cie de Financement Foncier SA 11/01/2028                  | 89 133           | 0,02              |
| 100 000 0.875% Cie de Financement Foncier SA 11/09/2028                  | 88 449           | 0,02              |
| 100 000 0.010% Cie de Financement Foncier SA 16/04/2029                  | 82 737           | 0,02              |
| 200 000 0.010% Cie de Financement Foncier SA 25/09/2030                  | 158 142          | 0,03              |
| 100 000 1.250% Cie de Financement Foncier SA 15/11/2032                  | 83 853           | 0,02              |
| 100 000 3.875% Cie de Financement Foncier SA 25/04/2055                  | 115 187          | 0,02              |
| 200 000 1.375% Cie de Saint-Gobain 14/06/2027                            | 183 866          | 0,04              |
| 200 000 1.875% Cie de Saint-Gobain 15/03/2031                            | 173 454          | 0,04              |

| Participation Investissement   | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>          |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b>    |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 1.000% Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 19/05/2031 | 82 603           | 0,02              |
| 100 000 0.875% Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 03/09/2025     | 94 455           | 0,02              |
| 100 000 0.000% Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 02/11/2028     | 83 240           | 0,02              |
| 100 000 2.375% Citigroup Inc 22/05/2024                                    | 98 459           | 0,02              |
| 260 000 1.500% Citigroup Inc 24/07/2026                                    | 244 559          | 0,05              |
| 100 000 0.500% Citigroup Inc 08/10/2027                                    | 87 904           | 0,02              |
| 100 000 4.112% Citigroup Inc 22/09/2033                                    | 97 468           | 0,02              |
| 100 000 0.875% CK Hutchison Finance 16 II Ltd 03/10/2024                   | 95 430           | 0,02              |
| 100 000 1.500% CK Hutchison Group Telecom Finance SA 17/10/2031            | 77 968           | 0,02              |
| 100 000 0.000% Clearstream Banking AG 01/12/2025                           | 91 501           | 0,02              |
| 100 000 1.500% Cloverie PLC for Zurich Insurance Co Ltd 15/12/2028         | 89 666           | 0,02              |
| 100 000 1.625% CNH Industrial Finance Europe SA 03/07/2029                 | 88 590           | 0,02              |
| 100 000 1.250% CNP Assurances 27/01/2029                                   | 81 795           | 0,02              |
| 100 000 4.250% CNP Assurances 05/06/2045                                   | 96 822           | 0,02              |
| 200 000 1.125% Coca-Cola Co 09/03/2027                                     | 183 774          | 0,04              |
| 100 000 0.125% Coca-Cola Co 15/03/2029                                     | 82 367           | 0,02              |
| 100 000 1.625% Coca-Cola Co 09/03/2035                                     | 81 478           | 0,02              |
| 100 000 0.800% Coca-Cola Co 15/03/2040                                     | 64 726           | 0,01              |
| 100 000 1.750% Coca-Cola Europacific Partners PLC 27/03/2026               | 94 642           | 0,02              |
| 100 000 1.500% Coca-Cola Europacific Partners PLC 08/11/2027               | 90 725           | 0,02              |
| 100 000 2.750% Coca-Cola HBC Finance BV 23/09/2025                         | 98 684           | 0,02              |
| 100 000 1.625% Coca-Cola HBC Finance BV 14/05/2031                         | 84 517           | 0,02              |
| 100 000 2.125% Coentreprise de Transport d'Electricite SA 29/07/2032       | 86 203           | 0,02              |
| 100 000 2.750% Coloplast Finance BV 19/05/2030                             | 93 858           | 0,02              |
| 100 000 0.000% Comcast Corp 14/09/2026                                     | 88 785           | 0,02              |
| 100 000 0.250% Comcast Corp 20/05/2027                                     | 87 493           | 0,02              |
| 100 000 0.625% Commerzbank AG 13/03/2025                                   | 94 860           | 0,02              |
| 100 000 0.625% Commerzbank AG 28/05/2025                                   | 94 420           | 0,02              |
| 155 000 0.100% Commerzbank AG 11/09/2025                                   | 141 406          | 0,03              |
| 100 000 2.750% Commerzbank AG 08/12/2025                                   | 98 722           | 0,02              |
| 100 000 0.500% Commerzbank AG 09/06/2026                                   | 91 814           | 0,02              |
| 100 000 1.125% Commerzbank AG 22/06/2026                                   | 88 895           | 0,02              |
| 100 000 0.500% Commerzbank AG 15/03/2027                                   | 90 205           | 0,02              |
| 100 000 0.625% Commerzbank AG 24/08/2027                                   | 89 774           | 0,02              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 3.000% Commerzbank AG 14/09/2027                                | 93 284           | 0,02              | 100 000 1.625% CPI Property Group SA 23/04/2027                         | 71 871           | 0,01              |
| 100 000 1.250% Commerzbank AG 09/01/2034                                | 82 995           | 0,02              | 250 000 0.375% CPPIB Capital Inc 20/06/2024                             | 240 980          | 0,05              |
| 100 000 0.500% Commonwealth Bank of Australia 27/07/2026                | 90 783           | 0,02              | 250 000 1.500% CPPIB Capital Inc 04/03/2033                             | 210 392          | 0,04              |
| 100 000 0.875% Commonwealth Bank of Australia 19/02/2029                | 86 694           | 0,02              | 100 000 2.000% Credit Agricole Assurances SA 17/07/2030                 | 80 809           | 0,02              |
| 100 000 1.625% Commonwealth Bank of Australia 10/02/2031                | 87 641           | 0,02              | 100 000 2.625% Credit Agricole Assurances SA 29/01/2048                 | 87 004           | 0,02              |
| 100 000 0.625% Compass Group Finance Netherlands BV 03/07/2024          | 96 611           | 0,02              | 100 000 4.250% Credit Agricole Assurances SA (Perpetual)                | 97 676           | 0,02              |
| 65 000 1.125% Conti-Gummi Finance BV 25/09/2024                         | 62 652           | 0,01              | 100 000 0.375% Credit Agricole Home Loan SFH SA 30/09/2024              | 95 617           | 0,02              |
| 100 000 3.625% Continental AG 30/11/2027                                | 98 947           | 0,02              | 100 000 0.125% Credit Agricole Home Loan SFH SA 16/12/2024              | 94 660           | 0,02              |
| 200 000 1.250% Cooperatieve Rabobank UA 23/03/2026                      | 187 892          | 0,04              | 100 000 0.500% Credit Agricole Home Loan SFH SA 03/04/2025              | 94 448           | 0,02              |
| 30 000 1.375% Cooperatieve Rabobank UA 03/02/2027                       | 27 779           | 0,00              | 200 000 3.250% Credit Agricole Home Loan SFH SA 28/09/2026              | 200 276          | 0,04              |
| 200 000 0.000% Cooperatieve Rabobank UA 21/06/2027                      | 175 706          | 0,04              | 100 000 0.750% Credit Agricole Home Loan SFH SA 05/05/2027              | 90 559           | 0,02              |
| 100 000 0.375% Cooperatieve Rabobank UA 01/12/2027                      | 87 350           | 0,02              | 100 000 2.875% Credit Agricole Home Loan SFH SA 23/06/2028              | 98 370           | 0,02              |
| 100 000 0.875% Cooperatieve Rabobank UA 08/02/2028                      | 90 022           | 0,02              | 100 000 1.250% Credit Agricole Home Loan SFH SA 24/03/2031              | 86 331           | 0,02              |
| 100 000 0.875% Cooperatieve Rabobank UA 01/02/2029                      | 88 312           | 0,02              | 100 000 0.010% Credit Agricole Home Loan SFH SA 03/11/2031              | 76 260           | 0,01              |
| 100 000 0.010% Cooperatieve Rabobank UA 02/07/2030                      | 80 167           | 0,02              | 100 000 0.375% Credit Agricole Home Loan SFH SA 01/02/2033              | 76 048           | 0,01              |
| 100 000 0.125% Cooperatieve Rabobank UA 01/12/2031                      | 77 582           | 0,02              | 100 000 0.875% Credit Agricole Home Loan SFH SA 06/05/2034              | 77 899           | 0,02              |
| 100 000 1.250% Cooperatieve Rabobank UA 31/05/2032                      | 85 177           | 0,02              | 100 000 1.500% Credit Agricole Home Loan SFH SA 28/09/2038              | 77 719           | 0,02              |
| 100 000 0.750% Cooperatieve Rabobank UA 21/06/2039                      | 68 290           | 0,01              | 100 000 1.125% Credit Agricole Italia SpA 21/03/2025                    | 95 421           | 0,02              |
| 100 000 0.010% Cooperatieve Rabobank UA 27/11/2040                      | 56 616           | 0,01              | 100 000 0.250% Credit Agricole Italia SpA 17/01/2028                    | 85 979           | 0,02              |
| 100 000 1.625% Corp Andina de Fomento 03/06/2025                        | 94 946           | 0,02              | 100 000 1.000% Credit Agricole Italia SpA 30/09/2031                    | 82 158           | 0,02              |
| 100 000 0.125% Council Of Europe Development Bank 10/04/2024            | 96 716           | 0,02              | 100 000 1.750% Credit Agricole Italia SpA 15/01/2038                    | 77 205           | 0,02              |
| 200 000 1.750% Council Of Europe Development Bank 24/04/2024            | 196 580          | 0,04              | 200 000 0.250% Credit Agricole Public Sector SCF SA 31/10/2026          | 179 886          | 0,04              |
| 100 000 0.750% Council Of Europe Development Bank 24/01/2028            | 90 153           | 0,02              | 100 000 1.000% Credit Agricole SA 18/09/2025                            | 94 182           | 0,02              |
| 150 000 0.050% Council Of Europe Development Bank 21/01/2030            | 123 610          | 0,02              | 100 000 2.625% Credit Agricole SA 17/03/2027                            | 93 982           | 0,02              |
| 100 000 2.875% Council Of Europe Development Bank 17/01/2033            | 98 435           | 0,02              | 100 000 3.375% Credit Agricole SA 28/07/2027                            | 98 389           | 0,02              |
| 50 000 1.750% Covestro AG 25/09/2024                                    | 48 788           | 0,01              | 100 000 0.125% Credit Agricole SA 09/12/2027                            | 84 536           | 0,02              |
| 100 000 1.500% Covivio 21/06/2027                                       | 88 165           | 0,02              | 100 000 0.375% Credit Agricole SA 20/04/2028                            | 83 430           | 0,02              |
|   |                  |                   | 100 000 1.125% Credit Agricole SA 24/02/2029                            | 86 594           | 0,02              |
|   |                  |                   | 100 000 4.250% Credit Agricole SA 11/07/2029                            | 100 231          | 0,02              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets | Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                     |                         | <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                     |                         | <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                     |                         | <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 300 000 2.500% Credit Agricole SA 29/08/2029                            | 281 268             | 0,06                    | 100 000 0.395% Danone SA 10/06/2029                                     | 83 704              | 0,02                    |
| 100 000 0.500% Credit Agricole SA/London 24/06/2024                     | 96 132              | 0,02                    | 100 000 0.500% Danske Bank A/S 27/08/2025                               | 94 729              | 0,02                    |
| 100 000 1.375% Credit Agricole SA/London 13/03/2025                     | 95 714              | 0,02                    | 100 000 0.750% Danske Bank A/S 22/11/2027                               | 89 703              | 0,02                    |
| 100 000 1.875% Credit Agricole SA/London 20/12/2026                     | 93 103              | 0,02                    | 100 000 2.500% Danske Bank A/S 21/06/2029                               | 96 392              | 0,02                    |
| 200 000 1.250% Credit Mutuel Arkea SA 11/06/2029                        | 171 966             | 0,04                    | 200 000 1.375% Danske Bank A/S 12/02/2030                               | 185 228             | 0,04                    |
| 200 000 0.625% Credit Mutuel Home Loan SFH SA 10/02/2025                | 189 918             | 0,04                    | 100 000 0.010% Danske Mortgage Bank PLC 24/11/2026                      | 89 062              | 0,02                    |
| 100 000 0.750% Credit Mutuel Home Loan SFH SA 15/09/2027                | 89 770              | 0,02                    | 100 000 0.375% Dassault Systemes SE 16/09/2029                          | 83 073              | 0,02                    |
| 100 000 2.750% Credit Mutuel Home Loan SFH SA 08/12/2027                | 97 826              | 0,02                    | 100 000 0.250% de Volksbank NV 22/06/2026                               | 88 328              | 0,02                    |
| 200 000 1.000% Credit Mutuel Home Loan SFH SA 30/04/2028                | 179 436             | 0,04                    | 100 000 1.000% de Volksbank NV 08/03/2028                               | 90 187              | 0,02                    |
| 100 000 0.010% Credit Mutuel Home Loan SFH SA 20/07/2028                | 84 599              | 0,02                    | 100 000 0.375% de Volksbank NV 16/09/2041                               | 59 128              | 0,01                    |
| 100 000 0.010% Credit Mutuel Home Loan SFH SA 06/05/2031                | 77 334              | 0,02                    | 100 000 0.750% Deutsche Apotheker-und Aertztebank eG 05/10/2027         | 90 074              | 0,02                    |
| 100 000 0.875% Credit Mutuel Home Loan SFH SA 04/03/2032                | 81 746              | 0,02                    | 100 000 0.010% Deutsche Apotheker-und Aertztebank eG 06/02/2029         | 83 718              | 0,02                    |
| 100 000 0.250% Credit Suisse AG/London 05/01/2026                       | 88 804              | 0,02                    | 100 000 3.750% Deutsche Bahn Finance GMBH 09/07/2025                    | 100 835             | 0,02                    |
| 100 000 0.250% Credit Suisse AG/London 01/09/2028                       | 78 465              | 0,02                    | 50 000 1.375% Deutsche Bahn Finance GMBH 28/03/2031                     | 43 426              | 0,01                    |
| 100 000 1.250% Credit Suisse Group AG 17/07/2025                        | 93 557              | 0,02                    | 300 000 1.625% Deutsche Bahn Finance GMBH 16/08/2033                    | 252 252             | 0,05                    |
| 100 000 3.250% Credit Suisse Group AG 02/04/2026                        | 94 516              | 0,02                    | 100 000 1.375% Deutsche Bahn Finance GMBH 03/03/2034                    | 80 435              | 0,02                    |
| 100 000 2.125% Credit Suisse Group AG 13/10/2026                        | 91 124              | 0,02                    | 100 000 0.625% Deutsche Bahn Finance GMBH 15/04/2036                    | 70 541              | 0,01                    |
| 100 000 7.750% Credit Suisse Group AG 01/03/2029                        | 109 431             | 0,02                    | 100 000 1.125% Deutsche Bahn Finance GMBH 29/05/2051                    | 57 102              | 0,01                    |
| 100 000 0.650% Credit Suisse Group AG 10/09/2029                        | 74 364              | 0,01                    | 100 000 1.600% Deutsche Bahn Finance GMBH (Perpetual)                   | 79 708              | 0,02                    |
| 100 000 0.625% Credit Suisse Group AG 18/01/2033                        | 65 048              | 0,01                    | 100 000 0.050% Deutsche Bank AG 20/11/2024                              | 94 436              | 0,02                    |
| 100 000 3.390% Credit Suisse Schweiz AG 05/12/2025                      | 98 312              | 0,02                    | 200 000 0.625% Deutsche Bank AG 21/08/2025                              | 187 674             | 0,04                    |
| 100 000 1.250% CRH SMW Finance DAC 05/11/2026                           | 92 446              | 0,02                    | 100 000 1.000% Deutsche Bank AG 19/11/2025                              | 92 403              | 0,02                    |
| 100 000 0.500% CTP NV 21/06/2025  | 87 743              | 0,02                    | 100 000 0.500% Deutsche Bank AG 22/01/2026                              | 92 545              | 0,02                    |
| 100 000 1.250% Daimler Truck International Finance BV 06/04/2025        | 95 564              | 0,02                    | 100 000 2.625% Deutsche Bank AG 12/02/2026                              | 92 657              | 0,02                    |
| 100 000 0.750% Danfoss Finance II BV 28/04/2031                         | 77 302              | 0,02                    | 100 000 1.375% Deutsche Bank AG 03/09/2026                              | 89 563              | 0,02                    |
| 100 000 1.250% Danone SA 30/05/2024                                     | 97 915              | 0,02                    | 100 000 1.625% Deutsche Bank AG 20/01/2027                              | 86 133              | 0,02                    |
| 100 000 1.208% Danone SA 03/11/2028                                     | 89 069              | 0,02                    | 100 000 1.750% Deutsche Bank AG 17/01/2028                              | 83 863              | 0,02                    |
|   |                     |                         | 100 000 1.875% Deutsche Bank AG 23/02/2028                              | 86 644              | 0,02                    |
|   |                     |                         | 100 000 5.375% Deutsche Bank AG 11/01/2029                              | 97 667              | 0,02                    |
|   |                     |                         | 100 000 1.750% Deutsche Bank AG 19/11/2030                              | 78 492              | 0,02                    |
|   |                     |                         | 100 000 1.375% Deutsche Bank AG 17/02/2032                              | 73 752              | 0,01                    |
|   |                     |                         | 100 000 2.500% Deutsche Bank AG 20/09/2032                              | 95 197              | 0,02                    |
|   |                     |                         | 100 000 1.625% Deutsche Kreditbank AG 05/05/2032                        | 88 902              | 0,02                    |
|   |                     |                         | 100 000 0.250% Deutsche Pfandbriefbank AG 27/10/2025                    | 87 402              | 0,02                    |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 200 000 0.010% Deutsche Pfandbriefbank AG 25/08/2026                    | 179 656          | 0,04              |
| 150 000 2.375% Deutsche Pfandbriefbank AG 29/05/2028                    | 144 418          | 0,03              |
| 50 000 1.250% Deutsche Pfandbriefbank AG 20/04/2035                     | 40 366           | 0,01              |
| 80 000 1.000% Deutsche Post AG 13/12/2027                               | 73 047           | 0,01              |
| 65 000 1.750% Deutsche Telekom AG 25/03/2031                            | 57 881           | 0,01              |
| 100 000 1.750% Deutsche Telekom AG 09/12/2049                           | 65 480           | 0,01              |
| 100 000 1.375% Deutsche Telekom International Finance BV 30/01/2027     | 93 133           | 0,02              |
| 200 000 3.250% Deutsche Telekom International Finance BV 17/01/2028     | 199 822          | 0,04              |
| 100 000 1.500% Deutsche Telekom International Finance BV 03/04/2028     | 91 365           | 0,02              |
| 100 000 1.000% Deutsche Wohnen SE 30/04/2025                            | 93 486           | 0,02              |
| 100 000 0.000% Dexia Credit Local SA 29/05/2024                         | 96 151           | 0,02              |
| 100 000 1.250% Dexia Credit Local SA 26/11/2024                         | 96 658           | 0,02              |
| 100 000 0.500% Dexia Credit Local SA 17/01/2025                         | 95 080           | 0,02              |
| 100 000 1.000% Dexia Credit Local SA 18/10/2027                         | 91 078           | 0,02              |
| 100 000 0.200% DH Europe Finance II Sarl 18/03/2026                     | 91 069           | 0,02              |
| 200 000 1.200% DH Europe Finance Sarl 30/06/2027                        | 182 762          | 0,04              |
| 100 000 1.875% Diageo Capital BV 08/06/2034                             | 84 492           | 0,02              |
| 100 000 2.375% Diageo Finance PLC 20/05/2026                            | 97 085           | 0,02              |
| 100 000 1.500% Digital Dutch Finco BV 15/03/2030                        | 77 988           | 0,02              |
| 100 000 1.375% Digital Intrepid Holding BV 18/07/2032                   | 70 349           | 0,01              |
| 100 000 0.250% DNB Bank ASA 09/04/2024                                  | 96 522           | 0,02              |
| 200 000 1.625% DNB Bank ASA 31/05/2026                                  | 190 848          | 0,04              |
| 100 000 0.625% DNB Boligkredit AS 19/06/2025                            | 94 210           | 0,02              |
| 100 000 0.625% DNB Boligkredit AS 14/01/2026                            | 92 789           | 0,02              |
| 100 000 0.250% DNB Boligkredit AS 07/09/2026                            | 90 216           | 0,02              |
| 100 000 0.010% DNB Boligkredit AS 21/01/2031                            | 78 147           | 0,02              |
| 100 000 1.125% Dow Chemical Co 15/03/2032                               | 76 932           | 0,01              |
| 100 000 2.375% DP World Ltd/United Arab Emirates 25/09/2026             | 94 369           | 0,02              |
| 100 000 1.375% DS Smith PLC 26/07/2024                                  | 95 977           | 0,02              |
| 100 000 1.375% DSV Finance BV 16/03/2030                                | 86 570           | 0,02              |
| 100 000 0.450% DXC Capital Funding DAC 15/09/2027                       | 81 755           | 0,02              |
| 100 000 0.375% DZ HYP AG 31/03/2026                                     | 91 861           | 0,02              |
| 100 000 0.500% DZ HYP AG 16/06/2026                                     | 91 788           | 0,02              |
| 200 000 0.100% DZ HYP AG 31/08/2026                                     | 180 114          | 0,04              |
| 100 000 0.010% DZ HYP AG 15/01/2027                                     | 88 787           | 0,02              |

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 0.500% DZ HYP AG 01/04/2027                                     | 90 125           | 0,02              |
| 100 000 0.750% DZ HYP AG 30/06/2027                                     | 90 588           | 0,02              |
| 100 000 0.875% DZ HYP AG 18/01/2030                                     | 86 628           | 0,02              |
| 100 000 0.010% DZ HYP AG 29/03/2030                                     | 80 938           | 0,02              |
| 100 000 0.375% DZ HYP AG 10/11/2034                                     | 72 998           | 0,01              |
| 100 000 1.250% E.ON International Finance BV 19/10/2027                 | 91 757           | 0,02              |
| 55 000 0.125% E.ON SE 18/01/2026  | 50 284           | 0,01              |
| 100 000 3.500% E.ON SE 12/01/2028                                       | 100 315          | 0,02              |
| 100 000 0.750% E.ON SE 20/02/2028                                       | 88 256           | 0,02              |
| 100 000 0.100% E.ON SE 19/12/2028                                       | 82 208           | 0,02              |
| 50 000 1.625% E.ON SE 29/03/2031  | 43 216           | 0,01              |
| 70 000 0.875% E.ON SE 20/08/2031  | 56 144           | 0,01              |
| 40 000 0.875% E.ON SE 18/10/2034  | 29 200           | 0,00              |
| 40 000 3.875% E.ON SE 12/01/2035  | 39 691           | 0,01              |
| 100 000 1.850% East Japan Railway Co 13/04/2033                         | 84 938           | 0,02              |
| 100 000 0.875% easyJet PLC 11/06/2025                                   | 93 778           | 0,02              |
| 100 000 0.697% Eaton Capital UnLtd Co 14/05/2025                        | 94 042           | 0,02              |
| 100 000 1.375% Edenred 18/06/2029                                       | 87 947           | 0,02              |
| 100 000 2.875% EDP - Energias de Portugal SA 01/06/2026                 | 97 321           | 0,02              |
| 100 000 1.875% EDP Finance BV 13/10/2025                                | 96 202           | 0,02              |
| 100 000 1.500% EDP Finance BV 22/11/2027                                | 91 053           | 0,02              |
| 100 000 0.010% Eika Boligkredit AS 12/03/2027                           | 88 143           | 0,02              |
| 200 000 1.000% Electricite de France SA 13/10/2026                      | 184 610          | 0,04              |
| 100 000 4.250% Electricite de France SA 25/01/2032                      | 99 225           | 0,02              |
| 300 000 1.000% Electricite de France SA 29/11/2033                      | 215 202          | 0,04              |
| 100 000 1.875% Electricite de France SA 13/10/2036                      | 74 320           | 0,01              |
| 100 000 4.625% Electricite de France SA 25/01/2043                      | 94 761           | 0,02              |
| 100 000 2.000% Electricite de France SA 09/12/2049                      | 60 623           | 0,01              |
| 100 000 4.125% Electrolux AB 05/10/2026                                 | 101 007          | 0,02              |
| 50 000 1.625% Eli Lilly & Co 02/06/2026                                 | 47 403           | 0,01              |
| 100 000 0.500% Eli Lilly & Co 14/09/2033                                | 74 908           | 0,01              |
| 100 000 1.375% Eli Lilly & Co 14/09/2061                                | 50 761           | 0,01              |
| 100 000 1.500% Elia Group SA/NV 05/09/2028                              | 88 882           | 0,02              |
| 100 000 1.375% Elia Transmission Belgium SA 14/01/2026                  | 94 582           | 0,02              |
| 100 000 2.600% ELM BV for Swiss Reinsurance Co Ltd (Perpetual)          | 91 047           | 0,02              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 100 000 2.875% ELO SACA 29/01/2026                                      | 94 605              | 0,02                    |
| 100 000 2.750% Emirates Telecommunications Group Co PJSC 18/06/2026     | 96 549              | 0,02                    |
| 100 000 0.375% Enagas Financiaciones SA 05/11/2032                      | 76 113              | 0,01                    |
| 100 000 0.625% EnBW International Finance BV 17/04/2025                 | 94 895              | 0,02                    |
| 200 000 3.625% EnBW International Finance BV 22/11/2026                 | 201 504             | 0,04                    |
| 100 000 0.125% EnBW International Finance BV 01/03/2028                 | 86 766              | 0,02                    |
| 50 000 4.049% EnBW International Finance BV 22/11/2029                  | 50 948              | 0,01                    |
| 100 000 0.000% Enel Finance International NV 17/06/2024                 | 95 918              | 0,02                    |
| 100 000 1.500% Enel Finance International NV 21/07/2025                 | 95 928              | 0,02                    |
| 100 000 0.250% Enel Finance International NV 17/11/2025                 | 92 127              | 0,02                    |
| 100 000 0.000% Enel Finance International NV 28/05/2026                 | 89 419              | 0,02                    |
| 100 000 0.000% Enel Finance International NV 17/06/2027                 | 85 487              | 0,02                    |
| 100 000 0.875% Enel Finance International NV 17/01/2031                 | 79 288              | 0,02                    |
| 100 000 4.000% Enel Finance International NV 20/02/2031                 | 99 167              | 0,02                    |
| 100 000 4.500% Enel Finance International NV 20/02/2043                 | 95 838              | 0,02                    |
| 100 000 5.250% Enel SpA 20/05/2024                                      | 101 835             | 0,02                    |
| 100 000 1.375% Enel SpA (Perpetual)                                     | 80 708              | 0,02                    |
| 100 000 1.875% Enel SpA (Perpetual)                                     | 71 744              | 0,01                    |
| 100 000 0.375% Enexis Holding NV 14/04/2033                             | 74 377              | 0,01                    |
| 100 000 1.000% Engie SA 13/03/2026                                      | 93 211              | 0,02                    |
| 100 000 0.375% Engie SA 11/06/2027                                      | 88 391              | 0,02                    |
| 200 000 1.750% Engie SA 27/03/2028                                      | 184 190             | 0,04                    |
| 100 000 3.625% Engie SA 11/01/2030                                      | 99 593              | 0,02                    |
| 100 000 4.000% Engie SA 11/01/2035                                      | 99 504              | 0,02                    |
| 100 000 1.500% Engie SA 13/03/2035                                      | 76 295              | 0,01                    |
| 100 000 1.000% Engie SA 26/10/2036                                      | 68 864              | 0,01                    |
| 100 000 1.625% Eni SpA 17/05/2028                                       | 91 236              | 0,02                    |
| 100 000 1.125% Eni SpA 19/09/2028                                       | 87 788              | 0,02                    |
| 100 000 3.625% Eni SpA 29/01/2029                                       | 100 118             | 0,02                    |
| 100 000 2.000% Eni SpA 18/05/2031                                       | 87 330              | 0,02                    |
| 100 000 2.000% Eni SpA (Perpetual)                                      | 84 290              | 0,02                    |
| 100 000 2.625% Eni SpA (Perpetual)                                      | 92 151              | 0,02                    |
| 200 000 1.816% EP Infrastructure AS 02/03/2031                          | 131 482             | 0,03                    |
| 100 000 0.875% EQT AB 14/05/2031  | 67 781              | 0,01                    |

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>   |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b>                                   |                     |                         |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 100 000 0.750% Equinor ASA 09/11/2026   | 90 862              | 0,02                    |
| 100 000 1.250% Equinor ASA 17/02/2027   | 92 043              | 0,02                    |
| 100 000 0.500% ERG SpA 11/09/2027   | 86 234              | 0,02                    |
| 100 000 0.625% Erste Group Bank AG 17/04/2026   | 92 172              | 0,02                    |
| 100 000 0.125% Erste Group Bank AG 17/05/2028   | 81 573              | 0,02                    |
| 200 000 0.010% Erste Group Bank AG 12/07/2028   | 169 068             | 0,03                    |
| 100 000 0.250% Erste Group Bank AG 14/09/2029   | 79 500              | 0,02                    |
| 200 000 1.000% Erste Group Bank AG 10/06/2030   | 179 492             | 0,04                    |
| 100 000 4.000% Erste Group Bank AG 16/01/2031   | 98 400              | 0,02                    |
| 200 000 1.875% ESB Finance DAC 14/06/2031   | 176 474             | 0,04                    |
| 100 000 0.125% EssilorLuxottica SA 27/05/2025   | 93 337              | 0,02                    |
| 100 000 0.750% EssilorLuxottica SA 27/11/2031   | 80 718              | 0,02                    |
| 100 000 0.250% Essity AB 08/02/2031   | 75 383              | 0,01                    |
| 100 000 3.000% Essity Capital BV 21/09/2026   | 98 206              | 0,02                    |
| 100 000 0.000% Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmateriale 28/07/2026 | 89 912              | 0,02                    |
| 100 000 0.100% Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmateriale 20/05/2030 | 81 135              | 0,02                    |
| 100 000 0.875% Eurofins Scientific SE 19/05/2031  | 73 928              | 0,01                    |
| 100 000 1.500% Eurogrid GmbH 18/04/2028   | 91 317              | 0,02                    |
| 100 000 1.125% Euronext NV 12/06/2029   | 87 323              | 0,02                    |
| 300 000 0.000% European Financial Stability Facility 19/04/2024   | 290 412             | 0,06                    |
| 100 000 0.375% European Financial Stability Facility 11/10/2024   | 95 953              | 0,02                    |
| 400 000 0.400% European Financial Stability Facility 17/02/2025   | 380 684             | 0,08                    |
| 100 000 0.200% European Financial Stability Facility 28/04/2025   | 94 263              | 0,02                    |
| 100 000 0.500% European Financial Stability Facility 11/07/2025   | 94 441              | 0,02                    |
| 350 000 0.000% European Financial Stability Facility 15/10/2025   | 324 618             | 0,07                    |
| 300 000 1.500% European Financial Stability Facility 15/12/2025   | 288 426             | 0,06                    |
| 200 000 0.400% European Financial Stability Facility 26/01/2026   | 186 084             | 0,04                    |
| 100 000 0.400% European Financial Stability Facility 31/05/2026   | 92 338              | 0,02                    |
| 100 000 0.000% European Financial Stability Facility 20/07/2026   | 90 769              | 0,02                    |
| 300 000 0.625% European Financial Stability Facility 16/10/2026   | 276 633             | 0,06                    |
| 200 000 0.750% European Financial Stability Facility 03/05/2027   | 183 418             | 0,04                    |
| 200 000 0.875% European Financial Stability Facility 26/07/2027   | 183 460             | 0,04                    |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets | Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                     |                         | <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                     |                         | <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                     |                         | <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 300 000 0.000% European Financial Stability Facility 13/10/2027         | 262 731             | 0,05                    | 190 000 0.250% European Investment Bank 14/10/2024                      | 182 100             | 0,04                    |
| 400 000 0.950% European Financial Stability Facility 14/02/2028         | 363 948             | 0,08                    | 100 000 0.000% European Investment Bank 25/03/2025                      | 94 146              | 0,02                    |
| 100 000 0.875% European Financial Stability Facility 05/09/2028         | 89 696              | 0,02                    | 100 000 0.125% European Investment Bank 15/04/2025                      | 94 284              | 0,02                    |
| 200 000 0.050% European Financial Stability Facility 17/10/2029         | 166 032             | 0,03                    | 100 000 0.375% European Investment Bank 16/07/2025                      | 94 220              | 0,02                    |
| 100 000 0.000% European Financial Stability Facility 20/01/2031         | 79 660              | 0,02                    | 150 000 2.750% European Investment Bank 15/09/2025                      | 149 010             | 0,03                    |
| 150 000 2.375% European Financial Stability Facility 21/06/2032         | 142 308             | 0,03                    | 200 000 4.500% European Investment Bank 15/10/2025                      | 207 028             | 0,04                    |
| 200 000 2.875% European Financial Stability Facility 16/02/2033         | 197 516             | 0,04                    | 200 000 0.000% European Investment Bank 13/03/2026                      | 183 504             | 0,04                    |
| 300 000 1.250% European Financial Stability Facility 24/05/2033         | 253 713             | 0,05                    | 250 000 0.375% European Investment Bank 14/04/2026                      | 231 345             | 0,05                    |
| 200 000 0.875% European Financial Stability Facility 10/04/2035         | 154 666             | 0,03                    | 100 000 0.100% European Investment Bank 15/10/2026                      | 90 655              | 0,02                    |
| 175 000 3.375% European Financial Stability Facility 03/04/2037         | 178 188             | 0,04                    | 500 000 0.000% European Investment Bank 22/12/2026                      | 449 150             | 0,09                    |
| 200 000 1.450% European Financial Stability Facility 05/09/2040         | 153 132             | 0,03                    | 300 000 0.500% European Investment Bank 15/01/2027                      | 274 209             | 0,06                    |
| 200 000 1.700% European Financial Stability Facility 13/02/2043         | 155 314             | 0,03                    | 200 000 3.500% European Investment Bank 15/04/2027                      | 204 124             | 0,04                    |
| 150 000 2.350% European Financial Stability Facility 29/07/2044         | 130 887             | 0,03                    | 300 000 0.375% European Investment Bank 15/09/2027                      | 268 584             | 0,06                    |
| 200 000 1.200% European Financial Stability Facility 17/02/2045         | 138 064             | 0,03                    | 400 000 0.000% European Investment Bank 15/11/2027                      | 350 708             | 0,07                    |
| 180 000 1.375% European Financial Stability Facility 31/05/2047         | 126 065             | 0,03                    | 100 000 0.875% European Investment Bank 14/01/2028                      | 91 115              | 0,02                    |
| 250 000 1.800% European Financial Stability Facility 10/07/2048         | 187 805             | 0,04                    | 100 000 0.000% European Investment Bank 28/03/2028                      | 86 601              | 0,02                    |
| 150 000 0.700% European Financial Stability Facility 20/01/2050         | 82 537              | 0,02                    | 200 000 0.000% European Investment Bank 15/05/2028                      | 172 486             | 0,04                    |
| 100 000 0.050% European Financial Stability Facility 18/01/2052         | 40 665              | 0,01                    | 200 000 2.750% European Investment Bank 28/07/2028                      | 198 710             | 0,04                    |
| 50 000 0.700% European Financial Stability Facility 17/01/2053          | 25 917              | 0,00                    | 100 000 0.000% European Investment Bank 28/09/2028                      | 85 439              | 0,02                    |
| 110 000 1.750% European Financial Stability Facility 17/07/2053         | 78 195              | 0,02                    | 300 000 0.625% European Investment Bank 22/01/2029                      | 263 700             | 0,05                    |
| 100 000 2.000% European Financial Stability Facility 28/02/2056         | 75 631              | 0,01                    | 350 000 0.125% European Investment Bank 20/06/2029                      | 295 508             | 0,06                    |
| 50 000 4.125% European Investment Bank 15/04/2024                       | 50 471              | 0,01                    | 100 000 0.050% European Investment Bank 15/11/2029                      | 83 060              | 0,02                    |
| 200 000 0.050% European Investment Bank 24/05/2024                      | 193 076             | 0,04                    | 100 000 0.050% European Investment Bank 16/01/2030                      | 82 603              | 0,02                    |
| 100 000 0.200% European Investment Bank 15/07/2024                      | 96 324              | 0,02                    | 300 000 2.250% European Investment Bank 15/03/2030                      | 287 460             | 0,06                    |
| 150 000 0.875% European Investment Bank 13/09/2024                      | 145 221             | 0,03                    | 140 000 4.000% European Investment Bank 15/04/2030                      | 149 503             | 0,03                    |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets | Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                     |                         | <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                     |                         | <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                     |                         | <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 300 000 0.000% European Investment Bank<br>09/09/2030                   | 242 163             | 0,05                    | 300 000 0.500% European Stability Mechanism<br>02/03/2026               | 279 240             | 0,06                    |
| 100 000 0.010% European Investment Bank<br>15/11/2030                   | 80 222              | 0,02                    | 200 000 0.000% European Stability Mechanism<br>15/12/2026               | 179 566             | 0,04                    |
| 200 000 0.000% European Investment Bank<br>14/01/2031                   | 159 402             | 0,03                    | 50 000 0.750% European Stability Mechanism<br>15/03/2027                | 45 949              | 0,01                    |
| 50 000 1.000% European Investment Bank<br>14/03/2031                    | 43 163              | 0,01                    | 300 000 3.000% European Stability Mechanism<br>15/03/2028               | 300 846             | 0,06                    |
| 300 000 0.250% European Investment Bank<br>20/01/2032                   | 237 576             | 0,05                    | 100 000 0.750% European Stability Mechanism<br>05/09/2028               | 89 141              | 0,02                    |
| 50 000 1.000% European Investment Bank<br>14/04/2032                    | 42 231              | 0,01                    | 400 000 0.010% European Stability Mechanism<br>15/10/2031               | 312 132             | 0,06                    |
| 200 000 1.500% European Investment Bank<br>15/06/2032                   | 176 628             | 0,04                    | 200 000 1.125% European Stability Mechanism<br>03/05/2032               | 170 486             | 0,03                    |
| 200 000 2.875% European Investment Bank<br>12/01/2033                   | 198 086             | 0,04                    | 200 000 1.200% European Stability Mechanism<br>23/05/2033               | 168 404             | 0,03                    |
| 150 000 1.125% European Investment Bank<br>13/04/2033                   | 125 691             | 0,03                    | 200 000 1.625% European Stability Mechanism<br>17/11/2036               | 165 160             | 0,03                    |
| 225 000 3.000% European Investment Bank<br>14/10/2033                   | 224 246             | 0,05                    | 175 000 0.875% European Stability Mechanism<br>18/07/2042               | 114 217             | 0,02                    |
| 200 000 0.050% European Investment Bank<br>13/10/2034                   | 141 752             | 0,03                    | 50 000 1.800% European Stability Mechanism<br>02/11/2046                | 38 477              | 0,01                    |
| 190 000 2.625% European Investment Bank<br>15/03/2035                   | 180 361             | 0,04                    | 50 000 1.850% European Stability Mechanism<br>01/12/2055                | 36 076              | 0,01                    |
| 100 000 0.200% European Investment Bank<br>17/03/2036                   | 68 830              | 0,01                    | 100 000 0.500% European Union 04/04/2025                                | 95 075              | 0,02                    |
| 100 000 1.125% European Investment Bank<br>15/09/2036                   | 77 839              | 0,02                    | 100 000 0.800% European Union 04/07/2025                                | 95 248              | 0,02                    |
| 120 000 0.500% European Investment Bank<br>13/11/2037                   | 82 817              | 0,02                    | 300 000 0.000% European Union 04/11/2025                                | 278 217             | 0,06                    |
| 100 000 0.250% European Investment Bank<br>15/06/2040                   | 60 956              | 0,01                    | 400 000 0.000% European Union 04/03/2026                                | 367 564             | 0,08                    |
| 100 000 0.010% European Investment Bank<br>15/05/2041                   | 56 286              | 0,01                    | 800 000 0.000% European Union 06/07/2026                                | 728 536             | 0,15                    |
| 160 000 1.750% European Investment Bank<br>15/09/2045                   | 123 066             | 0,02                    | 150 000 3.000% European Union 04/09/2026                                | 150 196             | 0,03                    |
| 50 000 0.875% European Investment Bank<br>13/09/2047                    | 30 732              | 0,01                    | 700 000 2.000% European Union 04/10/2027                                | 673 645             | 0,14                    |
| 100 000 1.500% European Investment Bank<br>15/11/2047                   | 71 637              | 0,01                    | 200 000 2.500% European Union 04/11/2027                                | 196 328             | 0,04                    |
| 100 000 1.500% European Investment Bank<br>16/10/2048                   | 70 307              | 0,01                    | 100 000 2.875% European Union 04/04/2028                                | 99 831              | 0,02                    |
| 100 000 0.125% European Stability Mechanism<br>22/04/2024               | 96 862              | 0,02                    | 300 000 0.000% European Union 02/06/2028                                | 258 654             | 0,05                    |
| 50 000 0.000% European Stability Mechanism<br>16/12/2024                | 47 469              | 0,01                    | 600 000 0.000% European Union 04/10/2028                                | 512 586             | 0,11                    |
| 100 000 0.000% European Stability Mechanism<br>14/03/2025               | 94 284              | 0,02                    | 300 000 0.000% European Union 04/07/2029                                | 250 725             | 0,05                    |
| 300 000 1.000% European Stability Mechanism<br>23/09/2025               | 285 798             | 0,06                    | 100 000 1.375% European Union 04/10/2029                                | 90 887              | 0,02                    |
|   |                     |                         | 200 000 1.625% European Union 04/12/2029                                | 184 394             | 0,04                    |
|   |                     |                         | 400 000 0.000% European Union 04/10/2030                                | 322 548             | 0,07                    |
|   |                     |                         | 150 000 0.750% European Union 04/04/2031                                | 126 930             | 0,03                    |
|   |                     |                         | 200 000 0.000% European Union 22/04/2031                                | 158 552             | 0,03                    |
|   |                     |                         | 800 000 0.000% European Union 04/07/2031                                | 630 176             | 0,13                    |
|   |                     |                         | 200 000 3.375% European Union 04/04/2032                                | 206 196             | 0,04                    |
|   |                     |                         | 300 000 1.000% European Union 06/07/2032                                | 252 774             | 0,05                    |
|   |                     |                         | 500 000 2.750% European Union 04/02/2033                                | 489 160             | 0,10                    |
|   |                     |                         | 100 000 1.250% European Union 04/04/2033                                | 84 588              | 0,02                    |
|   |                     |                         | 300 000 3.250% European Union 04/07/2034                                | 303 870             | 0,06                    |



## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 400 000 0.000% European Union 04/07/2035                                | 273 924          | 0,06              |
| 100 000 1.125% European Union 04/04/2036                                | 78 997           | 0,02              |
| 200 000 0.250% European Union 22/04/2036                                | 138 606          | 0,03              |
| 600 000 0.200% European Union 04/06/2036                                | 408 054          | 0,09              |
| 600 000 0.400% European Union 04/02/2037                                | 413 952          | 0,09              |
| 400 000 2.750% European Union 04/12/2037                                | 378 816          | 0,08              |
| 300 000 0.100% European Union 04/10/2040                                | 174 765          | 0,04              |
| 550 000 0.450% European Union 04/07/2041                                | 336 611          | 0,07              |
| 30 000 3.750% European Union 04/04/2042                                 | 31 862           | 0,01              |
| 500 000 3.375% European Union 04/11/2042                                | 502 611          | 0,11              |
| 200 000 1.250% European Union 04/02/2043                                | 140 972          | 0,03              |
| 100 000 0.450% European Union 02/05/2046                                | 55 348           | 0,01              |
| 400 000 0.750% European Union 04/01/2047                                | 237 224          | 0,05              |
| 400 000 2.625% European Union 04/02/2048                                | 355 668          | 0,07              |
| 450 000 0.300% European Union 04/11/2050                                | 212 557          | 0,04              |
| 600 000 0.700% European Union 06/07/2051                                | 323 466          | 0,07              |
| 200 000 2.500% European Union 04/10/2052                                | 170 642          | 0,03              |
| 200 000 3.000% European Union 04/03/2053                                | 188 382          | 0,04              |
| 100 000 2.000% Eutelsat SA 02/10/2025                                   | 91 452           | 0,02              |
| 100 000 0.625% Evonik Industries AG 18/09/2025                          | 92 807           | 0,02              |
| 100 000 2.250% EXOR NV 29/04/2030                                       | 88 239           | 0,02              |
| 100 000 0.524% Exxon Mobil Corp 26/06/2028                              | 86 000           | 0,02              |
| 100 000 1.408% Exxon Mobil Corp 26/06/2039                              | 66 925           | 0,01              |
| 100 000 0.500% FCA Bank SpA/Ireland 13/09/2024                          | 95 013           | 0,02              |
| 100 000 2.000% Federation des Caisses Desjardins du Quebec 31/08/2026   | 95 432           | 0,02              |
| 145 000 0.450% FedEx Corp 04/05/2029                                    | 116 899          | 0,02              |
| 100 000 1.382% Ferrovial Emisiones SA 14/05/2026                        | 93 209           | 0,02              |
| 200 000 2.000% Fidelity National Information Services Inc 21/05/2030    | 174 566          | 0,04              |
| 100 000 0.000% Finnvera Oyj 15/09/2027                                  | 87 484           | 0,02              |
| 100 000 1.750% Firmenich Productions Participations SAS 30/04/2030      | 88 668           | 0,02              |
| 100 000 1.625% Fiserv Inc 01/07/2030                                    | 84 131           | 0,02              |
| 100 000 2.875% FLUVIUS System Operator CVBA 07/05/2029                  | 95 996           | 0,02              |
| 100 000 0.375% FMS Wertmanagement 29/04/2030                            | 83 509           | 0,02              |
| 100 000 1.625% Fortum Oyj 27/02/2026                                    | 93 959           | 0,02              |
| 45 000 0.625% Fresenius Medical Care AG & Co KGaA 30/11/2026            | 40 432           | 0,01              |
| 40 000 0.375% Fresenius SE & Co KGaA 28/09/2026                         | 35 713           | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 200 000 0.750% Fresenius SE & Co KGaA 15/01/2028                        | 172 652          | 0,04              |
| 100 000 5.000% Fresenius SE & Co KGaA 28/11/2029                        | 102 125          | 0,02              |
| 100 000 0.125% GAS Networks Ireland 04/12/2024                          | 94 527           | 0,02              |
| 100 000 6.025% GE Capital European Funding Unlimited Co 01/03/2038      | 120 911          | 0,02              |
| 100 000 1.500% Gecina SA 20/01/2025                                     | 95 985           | 0,02              |
| 100 000 0.875% Gecina SA 30/06/2036                                     | 65 071           | 0,01              |
| 50 000 4.125% General Electric Co 19/09/2035                            | 49 604           | 0,01              |
| 100 000 0.450% General Mills Inc 15/01/2026                             | 91 802           | 0,02              |
| 100 000 1.694% General Motors Financial Co Inc 26/03/2025               | 95 850           | 0,02              |
| 100 000 0.850% General Motors Financial Co Inc 26/02/2026               | 90 972           | 0,02              |
| 130 000 4.000% GlaxoSmithKline Capital PLC 16/06/2025                   | 132 076          | 0,03              |
| 100 000 1.250% GlaxoSmithKline Capital PLC 21/05/2026                   | 93 932           | 0,02              |
| 100 000 1.125% Glencore Capital Finance DAC 10/03/2028                  | 86 058           | 0,02              |
| 100 000 0.750% Glencore Capital Finance DAC 01/03/2029                  | 80 926           | 0,02              |
| 100 000 2.250% Global Switch Holdings Ltd 31/05/2027                    | 93 883           | 0,02              |
| 100 000 3.000% Globalworth Real Estate Investments Ltd 29/03/2025       | 86 929           | 0,02              |
| 100 000 1.375% Goldman Sachs Group Inc 15/05/2024                       | 97 516           | 0,02              |
| 100 000 0.125% Goldman Sachs Group Inc 19/08/2024                       | 95 340           | 0,02              |
| 200 000 2.125% Goldman Sachs Group Inc 30/09/2024                       | 195 712          | 0,04              |
| 100 000 1.625% Goldman Sachs Group Inc 27/07/2026                       | 93 421           | 0,02              |
| 100 000 2.000% Goldman Sachs Group Inc 01/11/2028                       | 90 292           | 0,02              |
| 100 000 0.875% Goldman Sachs Group Inc 09/05/2029                       | 82 301           | 0,02              |
| 155 000 4.000% Goldman Sachs Group Inc 21/09/2029                       | 152 983          | 0,03              |
| 50 000 0.875% Goldman Sachs Group Inc 21/01/2030                        | 40 154           | 0,01              |
| 60 000 0.750% Goldman Sachs Group Inc 23/03/2032                        | 44 159           | 0,01              |
| 100 000 1.875% Groupe Bruxelles Lambert NV 19/06/2025                   | 96 371           | 0,02              |
| 100 000 1.625% Groupe VYV 02/07/2029                                    | 83 484           | 0,02              |
| 100 000 1.250% GSK Consumer Healthcare Capital NL BV 29/03/2026         | 92 909           | 0,02              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR  | % des<br>actifs<br>nets | Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets   |         |      |
|---|--|-------------------------|---|---------------------|---|---------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |  |                         | <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                     |   |         |      |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |  |                         | <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                     |   |         |      |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |  |                         | <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                     |   |         |      |
| 100 000   | 1.375% Hamburg Commercial Bank AG<br>27/05/2025                  | 95 487                  | 0,02  | 100 000             | 0.375% HYPO NOE Landesbank fuer<br>Niederosterreich und Wien AG<br>25/06/2024 | 95 264  | 0,02 |
| 100 000   | 0.375% Hamburg Commercial Bank AG<br>09/03/2026                  | 87 207                  | 0,02  | 100 000             | 0.125% HYPO NOE Landesbank fuer<br>Niederosterreich und Wien AG<br>23/06/2031 | 77 605  | 0,02 |
| 100 000   | 0.375% Hamburger Sparkasse AG<br>23/05/2024                      | 96 554                  | 0,02  | 100 000             | 0.010% Hypo Tirol Bank AG 11/03/2031  | 77 392  | 0,02 |
| 100 000   | 3.375% Hannover Rueck SE (Perpetual)                             | 95 056                  | 0,02  | 100 000             | 0.250% Hypo Vorarlberg Bank AG<br>21/05/2027                                  | 88 254  | 0,02 |
| 100 000   | 0.900% Harley-Davidson Financial<br>Services Inc 19/11/2024      | 95 288                  | 0,02  | 100 000             | 0.875% Iberdrola Finanzas SA 16/06/2025                                       | 94 829  | 0,02 |
| 100 000   | 1.500% Heathrow Funding Ltd 11/02/2030                           | 84 695                  | 0,02  | 100 000             | 3.125% Iberdrola Finanzas SA 22/11/2028                                       | 99 016  | 0,02 |
| 200 000   | 1.500% HeidelbergCement Finance<br>Luxembourg SA 14/06/2027      | 185 264                 | 0,04  | 100 000             | 1.621% Iberdrola Finanzas SA 29/11/2029                                       | 91 368  | 0,02 |
| 25 000  | 1.750% HeidelbergCement Finance<br>Luxembourg SA 24/04/2028      | 22 335                  | 0,00  | 100 000             | 3.375% Iberdrola Finanzas SA 22/11/2032                                       | 98 633  | 0,02 |
| 100 000   | 1.375% Heimstaden Bostad Treasury BV<br>24/07/2028               | 73 567                  | 0,01  | 100 000             | 1.874% Iberdrola International BV<br>(Perpetual)                              | 89 916  | 0,02 |
| 100 000   | 0.750% Heimstaden Bostad Treasury BV<br>06/09/2029               | 65 659                  | 0,01  | 100 000             | 2.250% Iberdrola International BV<br>(Perpetual)                              | 81 541  | 0,02 |
| 100 000   | 2.875% Heineken NV 04/08/2025                                    | 99 099                  | 0,02  | 100 000             | 1.125% ICADE 17/11/2025   | 93 291  | 0,02 |
| 100 000   | 1.250% Heineken NV 17/03/2027                                    | 91 684                  | 0,02  | 100 000             | 2.000% Ignitis Grupe AB 21/05/2030  | 83 769  | 0,02 |
| 100 000   | 3.875% Heineken NV 23/09/2030                                    | 102 049                 | 0,02  | 200 000             | 1.000% Illinois Tool Works Inc 05/06/2031                                     | 164 190 | 0,03 |
| 100 000   | 4.125% Heineken NV 23/03/2035                                    | 102 807                 | 0,02  | 100 000             | 1.875% Imerys SA 31/03/2028   | 89 770  | 0,02 |
| 100 000   | 0.250% Hera SpA 03/12/2030                                       | 74 926                  | 0,01  | 100 000             | 1.750% Imperial Brands Finance<br>Netherlands BV 18/03/2033                   | 72 279  | 0,01 |
| 100 000   | 1.000% Hera SpA 25/04/2034                                       | 72 405                  | 0,01  | 100 000             | 2.125% Indigo Group SAS 16/04/2025  | 96 750  | 0,02 |
| 100 000   | 0.934% Highland Holdings Sarl<br>15/12/2031                      | 76 351                  | 0,01  | 100 000             | 1.125% Infineon Technologies AG<br>24/06/2026                                 | 92 543  | 0,02 |
| 100 000   | 1.750% HOCHTIEF AG 03/07/2025                                    | 96 091                  | 0,02  | 100 000             | 3.000% ING Bank NV 15/02/2026   | 99 339  | 0,02 |
| 100 000   | 0.125% Holcim Finance Luxembourg SA<br>19/07/2027                | 86 792                  | 0,02  | 100 000             | 0.500% ING Bank NV 17/02/2027   | 90 338  | 0,02 |
| 100 000   | 0.500% Holcim Finance Luxembourg SA<br>23/04/2031                | 74 608                  | 0,01  | 100 000             | 0.875% ING Bank NV 11/04/2028   | 89 687  | 0,02 |
| 100 000   | 0.625% Holcim Finance Luxembourg SA<br>19/01/2033                | 70 205                  | 0,01  | 100 000             | 2.500% ING Bank NV 21/02/2030   | 96 327  | 0,02 |
| 100 000   | 2.500% Holding d'Infrastructures de<br>Transport SASU 04/05/2027 | 94 004                  | 0,02  | 100 000             | 1.000% ING Bank NV 17/02/2037   | 75 195  | 0,01 |
| 100 000   | 0.750% Honeywell International Inc<br>10/03/2032                 | 77 067                  | 0,02  | 200 000             | 0.750% ING Belgium SA 28/09/2026  | 183 566 | 0,04 |
| 100 000   | 1.125% HOWOGE Wohnungs-<br>baugesellschaft mbH 01/11/2033        | 72 280                  | 0,01  | 100 000             | 4.875% ING Groep NV 14/11/2027  | 101 700 | 0,02 |
| 200 000   | 0.875% HSBC Holdings PLC 06/09/2024                              | 192 436                 | 0,04  | 200 000             | 0.375% ING Groep NV 29/09/2028  | 167 424 | 0,03 |
| 200 000   | 3.000% HSBC Holdings PLC 30/06/2025                              | 195 114                 | 0,04  | 100 000             | 0.250% ING Groep NV 18/02/2029  | 81 553  | 0,02 |
| 100 000   | 3.019% HSBC Holdings PLC 15/06/2027                              | 96 128                  | 0,02  | 100 000             | 0.250% ING Groep NV 01/02/2030  | 78 621  | 0,02 |
| 100 000   | 4.752% HSBC Holdings PLC 10/03/2028                              | 101 731                 | 0,02  | 100 000             | 2.000% ING Groep NV 22/03/2030  | 93 463  | 0,02 |
| 100 000   | 0.641% HSBC Holdings PLC 24/09/2029                              | 82 429                  | 0,02  | 100 000             | 1.000% ING Groep NV 13/11/2030  | 89 290  | 0,02 |
| 100 000   | 4.787% HSBC Holdings PLC 10/03/2032                              | 102 448                 | 0,02  | 100 000             | 0.875% ING Groep NV 29/11/2030  | 79 795  | 0,02 |
| 100 000   | 2.500% HSBC SFH France SA<br>28/06/2028                          | 96 284                  | 0,02  | 100 000             | 1.750% ING Groep NV 16/02/2031  | 84 071  | 0,02 |
| 100 000   | 2.625% HSBC SFH France SA<br>07/09/2032                          | 94 800                  | 0,02  | 100 000             | 2.125% ING Groep NV 26/05/2031  | 91 509  | 0,02 |
|   |  |                         |   | 100 000             | 0.875% ING Groep NV 09/06/2032  | 84 690  | 0,02 |
|   |  |                         |   | 100 000             | 1.000% ING Groep NV 16/11/2032  | 82 594  | 0,02 |
|   |  |                         |   | 100 000             | 5.000% ING Groep NV 20/02/2035  | 98 168  | 0,02 |
|   |  |                         |   | 100 000             | 0.250% ING-DiBa AG 16/11/2026   | 90 117  | 0,02 |
|   |  |                         |   | 100 000             | 0.125% ING-DiBa AG 23/05/2027   | 88 420  | 0,02 |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>             |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 1.000% ING-DiBa AG 23/05/2039   | 71 669           | 0,01              |
| 100 000 1.625% Inmobiliaria Colonial Socimi SA 28/11/2025                     | 94 333           | 0,02              |
| 100 000 2.125% InterContinental Hotels Group PLC 15/05/2027                   | 92 941           | 0,02              |
| 100 000 0.000% International Bank for Reconstruction & Development 15/01/2027 | 89 293           | 0,02              |
| 150 000 0.250% International Bank for Reconstruction & Development 21/05/2029 | 127 291          | 0,03              |
| 200 000 0.000% International Bank for Reconstruction & Development 21/02/2030 | 163 062          | 0,03              |
| 50 000 0.500% International Bank for Reconstruction & Development 16/04/2030  | 42 154           | 0,01              |
| 100 000 0.625% International Bank for Reconstruction & Development 12/01/2033 | 79 753           | 0,02              |
| 100 000 2.900% International Bank for Reconstruction & Development 19/01/2033 | 98 404           | 0,02              |
| 200 000 0.100% International Bank for Reconstruction & Development 17/09/2035 | 137 834          | 0,03              |
| 100 000 0.250% International Bank for Reconstruction & Development 10/01/2050 | 47 867           | 0,01              |
| 100 000 0.125% International Bank for Reconstruction & Development 03/01/2051 | 44 567           | 0,01              |
| 100 000 0.200% International Bank for Reconstruction & Development 21/01/2061 | 36 192           | 0,01              |
| 100 000 0.875% International Business Machines Corp 31/01/2025                | 95 468           | 0,02              |
| 100 000 0.950% International Business Machines Corp 23/05/2025                | 95 002           | 0,02              |
| 100 000 0.300% International Business Machines Corp 11/02/2028                | 85 729           | 0,02              |
| 100 000 0.875% International Business Machines Corp 09/02/2030                | 83 678           | 0,02              |
| 100 000 1.250% International Business Machines Corp 09/02/2034                | 77 242           | 0,02              |
| 200 000 3.750% International Business Machines Corp 06/02/2035                | 196 658          | 0,04              |
| 200 000 0.000% International Development Association 19/10/2026               | 179 090          | 0,04              |
| 100 000 0.350% International Development Association 22/04/2036               | 70 691           | 0,01              |
| 100 000 1.750% International Development Association 05/05/2037               | 84 291           | 0,02              |

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 2.500% International Development Association 15/01/2038         | 92 271           | 0,02              |
| 100 000 1.250% International Distributions Services PLC 08/10/2026      | 90 427           | 0,02              |
| 100 000 1.000% Intesa Sanpaolo SpA 04/07/2024                           | 96 539           | 0,02              |
| 100 000 0.500% Intesa Sanpaolo SpA 15/07/2024                           | 96 155           | 0,02              |
| 100 000 1.125% Intesa Sanpaolo SpA 14/07/2025                           | 94 916           | 0,02              |
| 200 000 1.000% Intesa Sanpaolo SpA 25/09/2025                           | 188 474          | 0,04              |
| 100 000 3.250% Intesa Sanpaolo SpA 10/02/2026                           | 99 404           | 0,02              |
| 100 000 0.375% Intesa Sanpaolo SpA 14/09/2026                           | 90 344           | 0,02              |
| 100 000 0.750% Intesa Sanpaolo SpA 16/03/2028                           | 85 130           | 0,02              |
| 100 000 5.250% Intesa Sanpaolo SpA 13/01/2030                           | 103 857          | 0,02              |
| 200 000 5.625% Intesa Sanpaolo SpA 08/03/2033                           | 195 990          | 0,04              |
| 100 000 1.750% Investitionsbank Berlin 02/03/2027                       | 95 327           | 0,02              |
| 100 000 0.010% Investitionsbank Berlin 15/07/2027                       | 87 955           | 0,02              |
| 100 000 0.375% Investor AB 29/10/2035                                   | 66 431           | 0,01              |
| 100 000 0.875% Iren SpA 04/11/2024                                      | 95 507           | 0,02              |
| 100 000 2.125% ISS Global A/S 02/12/2024                                | 97 131           | 0,02              |
| 100 000 1.250% JAB Holdings BV 22/05/2024                               | 97 547           | 0,02              |
| 100 000 4.750% JAB Holdings BV 29/06/2032                               | 100 945          | 0,02              |
| 100 000 2.625% JCDecaux SE 24/04/2028                                   | 90 851           | 0,02              |
| 100 000 0.500% JDE Peet's NV 16/01/2029                                 | 80 617           | 0,02              |
| 100 000 2.200% John Deere Cash Management SARL 02/04/2032               | 91 459           | 0,02              |
| 100 000 0.650% Johnson & Johnson 20/05/2024                             | 97 246           | 0,02              |
| 100 000 1.375% Johnson Controls International plc 25/02/2025            | 96 071           | 0,02              |
| 100 000 3.000% JPMorgan Chase & Co 19/02/2026                           | 98 569           | 0,02              |
| 100 000 1.638% JPMorgan Chase & Co 18/05/2028                           | 90 479           | 0,02              |
| 100 000 1.812% JPMorgan Chase & Co 12/06/2029                           | 89 412           | 0,02              |
| 100 000 1.963% JPMorgan Chase & Co 23/03/2030                           | 88 440           | 0,02              |
| 100 000 1.047% JPMorgan Chase & Co 04/11/2032                           | 77 685           | 0,02              |
| 300 000 0.597% JPMorgan Chase & Co 17/02/2033                           | 223 713          | 0,05              |
| 100 000 1.000% JT International Financial Services BV 26/11/2029        | 80 906           | 0,02              |
| 100 000 4.625% Jyske Bank A/S 11/04/2026                                | 100 017          | 0,02              |
| 100 000 0.500% Jyske Realkredit A/S 01/10/2026                          | 90 799           | 0,02              |
| 100 000 0.000% KAF Kaemtner Ausgleichszahlungs-Fonds 14/01/2032         | 74 871           | 0,01              |
| 100 000 0.750% KBC Bank NV 24/10/2027                                   | 89 834           | 0,02              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 1.500% KBC Group NV 29/03/2026                                  | 94 994           | 0,02              |
| 100 000 0.375% KBC Group NV 16/06/2027                                  | 89 235           | 0,02              |
| 100 000 4.375% KBC Group NV 23/11/2027                                  | 100 075          | 0,02              |
| 100 000 0.750% KBC Group NV 21/01/2028                                  | 88 003           | 0,02              |
| 100 000 0.500% KBC Group NV 03/12/2029                                  | 92 496           | 0,02              |
| 100 000 1.000% Kellogg Co 17/05/2024                                    | 97 075           | 0,02              |
| 100 000 3.250% Kering SA 27/02/2029                                     | 99 430           | 0,02              |
| 100 000 3.375% Kering SA 27/02/2033                                     | 98 700           | 0,02              |
| 100 000 0.875% Kerry Group Financial Services Unltd Co 01/12/2031       | 79 388           | 0,02              |
| 200 000 1.250% Klepierre SA 29/09/2031                                  | 150 932          | 0,03              |
| 100 000 1.125% Knorr-Bremse AG 13/06/2025                               | 95 395           | 0,02              |
| 100 000 1.750% Koninklijke Ahold Delhaize NV 02/04/2027                 | 93 444           | 0,02              |
| 100 000 0.625% Koninklijke DSM NV 23/06/2032                            | 79 269           | 0,02              |
| 100 000 5.625% Koninklijke KPN NV 30/09/2024                            | 103 059          | 0,02              |
| 100 000 0.500% Koninklijke Philips NV 22/05/2026                        | 90 543           | 0,02              |
| 100 000 2.625% Koninklijke Philips NV 05/05/2033                        | 88 921           | 0,02              |
| 100 000 2.250% Kraft Heinz Foods Co 25/05/2028                          | 93 185           | 0,02              |
| 200 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 02/04/2024               | 194 038          | 0,04              |
| 250 000 1.500% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 11/06/2024               | 245 635          | 0,05              |
| 200 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 04/07/2024               | 192 762          | 0,04              |
| 200 000 0.125% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 04/10/2024               | 191 632          | 0,04              |
| 450 000 0.625% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/01/2025               | 431 590          | 0,09              |
| 200 000 0.010% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 31/03/2025               | 188 556          | 0,04              |
| 100 000 0.375% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 23/04/2025               | 94 897           | 0,02              |
| 100 000 0.125% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 30/06/2025               | 93 976           | 0,02              |
| 400 000 0.250% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/09/2025               | 375 092          | 0,08              |
| 200 000 0.375% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 09/03/2026               | 185 854          | 0,04              |
| 700 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/06/2026               | 638 491          | 0,13              |
| 400 000 0.500% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 28/09/2026               | 368 968          | 0,08              |
| 200 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 30/09/2026               | 181 116          | 0,04              |
| 200 000 0.625% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 22/02/2027               | 183 372          | 0,04              |
| 100 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 31/03/2027               | 89 207           | 0,02              |

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 400 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 30/04/2027               | 356 116          | 0,07              |
| 100 000 0.010% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 05/05/2027               | 88 980           | 0,02              |
| 400 000 1.250% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 30/06/2027               | 373 928          | 0,08              |
| 300 000 0.500% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/09/2027               | 270 348          | 0,06              |
| 100 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/12/2027               | 87 543           | 0,02              |
| 100 000 0.625% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 07/01/2028               | 90 180           | 0,02              |
| 150 000 0.750% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 28/06/2028               | 134 922          | 0,03              |
| 200 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/09/2028               | 171 608          | 0,04              |
| 200 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 09/11/2028               | 170 946          | 0,03              |
| 200 000 0.750% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/01/2029               | 177 656          | 0,04              |
| 200 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/06/2029               | 167 966          | 0,03              |
| 200 000 2.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/11/2029               | 190 054          | 0,04              |
| 200 000 2.875% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 28/12/2029               | 200 506          | 0,04              |
| 140 000 0.375% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 23/04/2030               | 118 195          | 0,02              |
| 150 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 17/09/2030               | 121 552          | 0,02              |
| 300 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 10/01/2031               | 241 083          | 0,05              |
| 300 000 0.125% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 09/01/2032               | 236 910          | 0,05              |
| 300 000 1.375% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 07/06/2032               | 264 501          | 0,05              |
| 200 000 1.125% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/09/2032               | 171 600          | 0,04              |
| 400 000 1.125% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 09/05/2033               | 338 256          | 0,07              |
| 150 000 1.375% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 31/07/2035               | 124 567          | 0,03              |
| 100 000 0.375% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 20/05/2036               | 71 193           | 0,01              |
| 100 000 1.125% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 31/03/2037               | 77 516           | 0,02              |
| 50 000 1.125% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/06/2037                | 38 538           | 0,01              |
| 200 000 0.875% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 04/07/2039               | 143 258          | 0,03              |
| 200 000 1.250% Kutxabank SA 22/09/2025                                  | 189 494          | 0,04              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>         |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b>   |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 200 000 0.010% La Banque Postale Home Loan SFH SA 22/10/2029              | 163 170          | 0,03              |
| 100 000 0.250% La Banque Postale Home Loan SFH SA 12/02/2035              | 70 380           | 0,01              |
| 100 000 1.000% La Banque Postale SA 09/02/2028                            | 87 509           | 0,02              |
| 100 000 2.000% La Banque Postale SA 13/07/2028                            | 89 703           | 0,02              |
| 200 000 0.875% La Banque Postale SA 26/01/2031                            | 176 496          | 0,04              |
| 200 000 2.125% La Mondiale SAM 23/06/2031                                 | 158 190          | 0,03              |
| 100 000 2.750% La Poste SA 26/11/2024                                     | 98 724           | 0,02              |
| 200 000 0.375% La Poste SA 17/09/2027                                     | 174 440          | 0,04              |
| 50 000 0.375% Landesbank Baden-Wuerttemberg 27/02/2025                    | 47 292           | 0,01              |
| 200 000 0.375% Landesbank Baden-Wuerttemberg 18/02/2027                   | 171 266          | 0,03              |
| 100 000 2.375% Landesbank Baden-Wuerttemberg 26/02/2027                   | 97 279           | 0,02              |
| 200 000 1.750% Landesbank Baden-Wuerttemberg 28/02/2028                   | 188 530          | 0,04              |
| 100 000 0.375% Landesbank Baden-Wuerttemberg 07/05/2029                   | 76 766           | 0,01              |
| 100 000 0.125% Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale 19/11/2024       | 94 288           | 0,02              |
| 100 000 0.010% Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale 22/01/2025       | 94 181           | 0,02              |
| 100 000 0.500% Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale 16/01/2026       | 92 791           | 0,02              |
| 100 000 0.625% Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale 12/01/2027       | 91 123           | 0,02              |
| 100 000 2.625% Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale 24/08/2027       | 94 622           | 0,02              |
| 100 000 0.375% Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale 04/06/2029       | 78 349           | 0,02              |
| 100 000 0.125% Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale 22/01/2030       | 82 229           | 0,02              |
| 100 000 0.375% Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank 13/04/2026 | 92 083           | 0,02              |
| 100 000 0.010% Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank 20/01/2031 | 79 702           | 0,02              |
| 100 000 0.500% Landsbankinn HF 20/05/2024                                 | 93 558           | 0,02              |
| 100 000 0.250% Landwirtschaftliche Rentenbank 15/07/2024                  | 96 418           | 0,02              |
| 200 000 0.500% Landwirtschaftliche Rentenbank 06/03/2025                  | 190 496          | 0,04              |
| 100 000 0.250% Landwirtschaftliche Rentenbank 29/08/2025                  | 93 694           | 0,02              |
| 200 000 0.375% Landwirtschaftliche Rentenbank 16/03/2026                  | 185 136          | 0,04              |

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 200 000 0.000% Landwirtschaftliche Rentenbank 28/09/2026                | 180 568          | 0,04              |
| 100 000 0.000% Landwirtschaftliche Rentenbank 19/07/2028                | 85 781           | 0,02              |
| 100 000 0.500% Landwirtschaftliche Rentenbank 28/02/2029                | 86 970           | 0,02              |
| 100 000 0.000% Landwirtschaftliche Rentenbank 27/11/2029                | 82 531           | 0,02              |
| 100 000 0.050% Landwirtschaftliche Rentenbank 18/12/2029                | 82 612           | 0,02              |
| 200 000 0.625% Landwirtschaftliche Rentenbank 31/10/2036                | 145 618          | 0,03              |
| 100 000 0.010% Landwirtschaftliche Rentenbank 26/11/2040                | 58 071           | 0,01              |
| 100 000 0.125% Lansforsakringar Bank AB 19/02/2025                      | 93 137           | 0,02              |
| 200 000 0.625% Lansforsakringar Hypotek AB 29/01/2026                   | 185 446          | 0,04              |
| 45 000 0.000% LANXESS AG 08/09/2027                                     | 38 696           | 0,01              |
| 100 000 1.750% LANXESS AG 22/03/2028                                    | 90 388           | 0,02              |
| 100 000 0.250% LeasePlan Corp NV 23/02/2026                             | 89 647           | 0,02              |
| 100 000 0.250% LeasePlan Corp NV 07/09/2026                             | 87 768           | 0,02              |
| 100 000 0.875% LEG Immobilien SE 17/01/2029                             | 78 242           | 0,02              |
| 100 000 0.750% Legrand SA 20/05/2030                                    | 84 103           | 0,02              |
| 200 000 0.050% LFA Foerderbank Bayern 30/07/2026                        | 181 028          | 0,04              |
| 100 000 0.250% Liberbank SA 25/09/2029                                  | 81 618           | 0,02              |
| 100 000 1.000% Linde PLC 31/03/2027                                     | 92 538           | 0,02              |
| 100 000 1.375% Linde PLC 31/03/2031                                     | 86 420           | 0,02              |
| 100 000 0.375% Lloyds Bank Corporate Markets PLC 28/01/2025             | 94 067           | 0,02              |
| 100 000 3.500% Lloyds Banking Group PLC 01/04/2026                      | 98 849           | 0,02              |
| 100 000 1.625% Logicor Financing Sarl 17/01/2030                        | 69 727           | 0,01              |
| 100 000 0.875% Logicor Financing Sarl 14/01/2031                        | 62 243           | 0,01              |
| 100 000 2.000% Logicor Financing Sarl 17/01/2034                        | 59 642           | 0,01              |
| 100 000 1.750% London Stock Exchange Group PLC 06/12/2027               | 92 473           | 0,02              |
| 100 000 0.539% Luminor Bank AS/Estonia 23/09/2026                       | 87 158           | 0,02              |
| 100 000 0.750% LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 07/04/2025           | 95 073           | 0,02              |
| 100 000 0.000% LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 11/02/2026           | 91 080           | 0,02              |
| 100 000 0.125% LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 11/02/2028           | 86 540           | 0,02              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 200 000 0.943% Macquarie Group Ltd 19/01/2029                           | 162 158          | 0,03              |
| 100 000 4.125% Mapfre SA 07/09/2048                                     | 91 357           | 0,02              |
| 100 000 1.349% Marsh & McLennan Cos Inc 21/09/2026                      | 91 762           | 0,02              |
| 100 000 2.100% Mastercard Inc 01/12/2027                                | 95 310           | 0,02              |
| 100 000 2.625% McDonald's Corp 11/06/2029                               | 93 794           | 0,02              |
| 100 000 1.600% McDonald's Corp 15/03/2031                               | 85 665           | 0,02              |
| 100 000 3.000% McDonald's Corp 31/05/2034                               | 92 560           | 0,02              |
| 100 000 0.375% MDGH GMTN RSC Ltd 10/03/2027                             | 87 724           | 0,02              |
| 100 000 1.625% Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 07/01/2025   | 96 077           | 0,02              |
| 100 000 1.375% Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 10/11/2025   | 94 619           | 0,02              |
| 100 000 1.000% Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 17/07/2029   | 83 335           | 0,02              |
| 100 000 0.000% Medtronic Global Holdings SCA 15/10/2025                 | 92 142           | 0,02              |
| 100 000 1.125% Medtronic Global Holdings SCA 07/03/2027                 | 91 875           | 0,02              |
| 100 000 0.375% Medtronic Global Holdings SCA 15/10/2028                 | 84 884           | 0,02              |
| 100 000 3.000% Medtronic Global Holdings SCA 15/10/2028                 | 97 741           | 0,02              |
| 100 000 2.250% Medtronic Global Holdings SCA 07/03/2039                 | 80 461           | 0,02              |
| 100 000 1.750% Medtronic Global Holdings SCA 02/07/2049                 | 63 006           | 0,01              |
| 100 000 1.375% Mercedes-Benz Group AG 11/05/2028                        | 90 883           | 0,02              |
| 100 000 1.500% Mercedes-Benz Group AG 03/07/2029                        | 89 542           | 0,02              |
| 65 000 0.750% Mercedes-Benz Group AG 08/02/2030                         | 54 475           | 0,01              |
| 45 000 0.750% Mercedes-Benz Group AG 10/09/2030                         | 37 437           | 0,01              |
| 5 000 0.750% Mercedes-Benz Group AG 11/03/2033                          | 3 868            | 0,00              |
| 200 000 1.125% Mercedes-Benz Group AG 08/08/2034                        | 154 278          | 0,03              |
| 100 000 0.875% Mercedes-Benz International Finance BV 09/04/2024        | 97 638           | 0,02              |
| 100 000 1.000% Mercedes-Benz International Finance BV 11/11/2025        | 94 330           | 0,02              |
| 100 000 1.375% Mercedes-Benz International Finance BV 26/06/2026        | 94 689           | 0,02              |
| 100 000 0.625% Mercedes-Benz International Finance BV 06/05/2027        | 89 850           | 0,02              |
| 100 000 2.500% Merck & Co Inc 15/10/2034                                | 90 863           | 0,02              |

| Participation Investissement   | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>        |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 0.125% Merck Financial Services GmbH 16/07/2025                  | 93 074           | 0,02              |
| 100 000 2.875% Merck KGaA 25/06/2079                                     | 87 510           | 0,02              |
| 100 000 1.625% Merck KGaA 09/09/2080                                     | 88 446           | 0,02              |
| 100 000 1.750% Merlin Properties Socimi SA 26/05/2025                    | 94 857           | 0,02              |
| 100 000 0.550% Metropolitan Life Global Funding I 16/06/2027             | 87 505           | 0,02              |
| 100 000 3.125% Microsoft Corp 06/12/2028                                 | 100 141          | 0,02              |
| 200 000 2.264% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 14/06/2025             | 195 154          | 0,04              |
| 100 000 0.184% Mizuho Financial Group Inc 13/04/2026                     | 88 996           | 0,02              |
| 100 000 4.157% Mizuho Financial Group Inc 20/05/2028                     | 100 243          | 0,02              |
| 100 000 0.470% Mizuho Financial Group Inc 06/09/2029                     | 82 011           | 0,02              |
| 100 000 0.693% Mizuho Financial Group Inc 07/10/2030                     | 78 289           | 0,02              |
| 100 000 2.096% Mizuho Financial Group Inc 08/04/2032                     | 83 863           | 0,02              |
| 100 000 0.750% MMB SCF SACA 31/10/2025                                   | 93 445           | 0,02              |
| 100 000 1.250% MMS USA Holdings Inc 13/06/2028                           | 88 774           | 0,02              |
| 100 000 1.875% Molnlycke Holding AB 28/02/2025                           | 96 230           | 0,02              |
| 100 000 1.250% Molson Coors Beverage Co 15/07/2024                       | 96 487           | 0,02              |
| 100 000 0.250% Mondelez International Holdings Netherlands BV 09/09/2029 | 80 528           | 0,02              |
| 100 000 0.625% Mondelez International Holdings Netherlands BV 09/09/2032 | 74 950           | 0,01              |
| 100 000 1.375% Mondelez International Inc 17/03/2041                     | 65 958           | 0,01              |
| 100 000 1.500% Mondi Finance PLC 15/04/2024                              | 97 601           | 0,02              |
| 100 000 0.950% Moody's Corp 25/02/2030                                   | 83 662           | 0,02              |
| 100 000 2.103% Morgan Stanley 08/05/2026                                 | 95 930           | 0,02              |
| 100 000 1.375% Morgan Stanley 27/10/2026                                 | 92 810           | 0,02              |
| 100 000 0.406% Morgan Stanley 29/10/2027                                 | 87 366           | 0,02              |
| 100 000 4.813% Morgan Stanley 25/10/2028                                 | 102 318          | 0,02              |
| 100 000 0.495% Morgan Stanley 26/10/2029                                 | 82 103           | 0,02              |
| 100 000 0.497% Morgan Stanley 07/02/2031                                 | 78 497           | 0,02              |
| 100 000 2.950% Morgan Stanley 07/05/2032                                 | 90 978           | 0,02              |
| 100 000 1.102% Morgan Stanley 29/04/2033                                 | 76 170           | 0,01              |
| 100 000 5.148% Morgan Stanley 25/01/2034                                 | 105 112          | 0,02              |
| 100 000 0.125% Motability Operations Group PLC 20/07/2028                | 84 130           | 0,02              |
| 100 000 0.500% Muenchener Hypothekbank eG 14/03/2025                     | 94 653           | 0,02              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets | Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>                         |                     |                         | <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b>                   |                     |                         | <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                     |                         | <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 100 000 2.750% Muenchener Hypothekbank eG<br>24/09/2025                                   | 98 940              | 0,02                    | 100 000 1.250% Naturgy Finance BV 15/01/2026                            | 93 515              | 0,02                    |
| 99 000 0.500% Muenchener Hypothekbank eG<br>22/04/2026                                    | 91 273              | 0,02                    | 100 000 1.750% NatWest Group PLC 02/03/2026                             | 95 198              | 0,02                    |
| 159 000 2.500% Muenchener Hypothekbank eG<br>04/07/2028                                   | 154 454             | 0,03                    | 100 000 5.763% NatWest Group PLC 28/02/2034                             | 100 768             | 0,02                    |
| 100 000 0.125% Muenchener Hypothekbank eG<br>05/09/2035                                   | 69 081              | 0,01                    | 100 000 0.125% NatWest Markets PLC 12/11/2025                           | 90 570              | 0,02                    |
| 100 000 0.010% Muenchener Hypothekbank eG<br>02/11/2040                                   | 57 279              | 0,01                    | 100 000 1.375% NatWest Markets PLC 02/03/2027                           | 90 157              | 0,02                    |
| 100 000 1.250% Muenchener<br>Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in<br>Muenchen 26/05/2041 | 74 886              | 0,01                    | 100 000 1.875% NE Property BV 09/10/2026                                | 85 404              | 0,02                    |
| 100 000 1.000% Muenchener<br>Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in<br>Muenchen 26/05/2042 | 70 356              | 0,01                    | 100 000 0.375% Nederlandse Gasunie NV<br>03/10/2031                     | 77 334              | 0,02                    |
| 100 000 0.875% Nasdaq Inc 13/02/2030  | 80 752              | 0,02                    | 60 000 0.000% Nestle Finance International Ltd<br>12/11/2024            | 57 280              | 0,01                    |
| 100 000 0.625% National Australia Bank Ltd<br>18/09/2024                                  | 95 719              | 0,02                    | 100 000 0.875% Nestle Finance International Ltd<br>29/03/2027           | 92 028              | 0,02                    |
| 200 000 0.750% National Australia Bank Ltd<br>30/01/2026                                  | 185 468             | 0,04                    | 71 000 3.500% Nestle Finance International Ltd<br>13/12/2027            | 72 262              | 0,01                    |
| 200 000 1.250% National Australia Bank Ltd<br>18/05/2026                                  | 187 980             | 0,04                    | 200 000 1.250% Nestle Finance International Ltd<br>29/03/2031           | 171 696             | 0,04                    |
| 100 000 0.875% National Australia Bank Ltd<br>19/02/2027                                  | 90 700              | 0,02                    | 100 000 3.750% Nestle Finance International Ltd<br>13/03/2033           | 103 749             | 0,02                    |
| 100 000 0.010% National Bank of Canada<br>29/09/2026                                      | 89 077              | 0,02                    | 100 000 0.875% Nestle Holdings Inc 18/07/2025                           | 95 346              | 0,02                    |
| 100 000 0.010% National Bank of Canada<br>25/03/2028                                      | 85 170              | 0,02                    | 100 000 0.250% New York Life Global Funding<br>23/01/2027               | 87 061              | 0,02                    |
| 100 000 1.000% National Grid North America Inc<br>12/07/2024                              | 96 522              | 0,02                    | 100 000 0.250% NIBC Bank NV 09/09/2026                                  | 85 016              | 0,02                    |
| 100 000 0.250% National Grid PLC 01/09/2028   | 82 766              | 0,02                    | 100 000 1.875% NIBC Bank NV 16/06/2027                                  | 94 510              | 0,02                    |
| 100 000 2.949% National Grid PLC 30/03/2030   | 93 569              | 0,02                    | 100 000 0.125% NIBC Bank NV 21/04/2031                                  | 78 260              | 0,02                    |
| 100 000 4.275% National Grid PLC 16/01/2035   | 99 054              | 0,02                    | 200 000 0.875% NN Group NV 23/11/2031                                   | 158 350             | 0,03                    |
| 100 000 0.500% National Westminster Bank PLC<br>15/05/2024                                | 96 668              | 0,02                    | 100 000 3.125% Nokia Oyj 15/05/2028                                     | 93 820              | 0,02                    |
| 100 000 3.250% Nationale-Nederlanden Bank NV/<br>The Netherlands 28/05/2027               | 100 241             | 0,02                    | 100 000 0.250% Norddeutsche Landesbank-<br>Girozentrale 28/10/2026      | 90 199              | 0,02                    |
| 100 000 0.500% Nationale-Nederlanden Bank NV/<br>The Netherlands 21/09/2028               | 82 665              | 0,02                    | 100 000 0.010% Norddeutsche Landesbank-<br>Girozentrale 18/02/2027      | 88 564              | 0,02                    |
| 100 000 1.000% Nationale-Nederlanden Bank NV/<br>The Netherlands 25/09/2028               | 89 220              | 0,02                    | 100 000 0.750% Norddeutsche Landesbank-<br>Girozentrale 18/01/2028      | 89 552              | 0,02                    |
| 100 000 2.000% Nationwide Building Society<br>28/04/2027                                  | 92 726              | 0,02                    | 150 000 0.750% Norddeutsche Landesbank-<br>Girozentrale 05/03/2029      | 131 113             | 0,03                    |
| 100 000 0.250% Nationwide Building Society<br>14/09/2028                                  | 80 958              | 0,02                    | 100 000 1.125% Nordea Bank Abp 16/02/2027                               | 90 375              | 0,02                    |
| 100 000 1.375% Nationwide Building Society<br>29/06/2032                                  | 84 787              | 0,02                    | 100 000 0.500% Nordea Bank Abp 14/05/2027                               | 88 100              | 0,02                    |
| 100 000 1.125% Naturgy Capital Markets SA<br>11/04/2024                                   | 97 846              | 0,02                    | 100 000 1.125% Nordea Bank Abp 27/09/2027                               | 89 957              | 0,02                    |
| 100 000 1.375% Naturgy Finance BV 21/01/2025  | 95 836              | 0,02                    | 100 000 0.500% Nordea Bank Abp 02/11/2028                               | 83 025              | 0,02                    |
|   |                     |                         | 100 000 2.500% Nordea Bank Abp 23/05/2029                               | 91 555              | 0,02                    |
|   |                     |                         | 100 000 2.625% Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj<br>01/12/2025           | 98 356              | 0,02                    |
|   |                     |                         | 200 000 0.625% Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj<br>17/03/2027           | 181 088             | 0,04                    |
|   |                     |                         | 100 000 0.125% Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj<br>18/06/2027           | 88 079              | 0,02                    |
|   |                     |                         | 100 000 1.375% Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj<br>28/02/2033           | 85 073              | 0,02                    |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 100 000 0.125% Nordic Investment Bank<br>10/06/2024                     | 96 219              | 0,02                    |
| 100 000 1.125% Norsk Hydro ASA 11/04/2025                               | 94 172              | 0,02                    |
| 100 000 0.905% NorteGas Energia Distribucion SA<br>22/01/2031           | 78 637              | 0,02                    |
| 235 000 0.000% Novartis Finance SA 23/09/2028                           | 197 421             | 0,04                    |
| 100 000 0.000% Novo Nordisk Finance<br>Netherlands BV 04/06/2024        | 96 217              | 0,02                    |
| 100 000 0.250% NRW Bank 16/05/2024                                      | 96 577              | 0,02                    |
| 100 000 0.250% NRW Bank 09/07/2024                                      | 96 186              | 0,02                    |
| 50 000 0.250% NRW Bank 10/03/2025                                       | 47 185              | 0,01                    |
| 100 000 0.250% NRW Bank 04/07/2025                                      | 93 619              | 0,02                    |
| 100 000 0.500% NRW Bank 11/05/2026                                      | 92 297              | 0,02                    |
| 100 000 0.250% NRW Bank 28/09/2026                                      | 90 779              | 0,02                    |
| 100 000 0.625% NRW Bank 04/01/2028                                      | 89 546              | 0,02                    |
| 100 000 0.750% NRW Bank 30/06/2028                                      | 89 144              | 0,02                    |
| 25 000 0.000% NRW Bank 22/09/2028                                       | 21 244              | 0,00                    |
| 100 000 1.625% NRW Bank 03/08/2032                                      | 89 059              | 0,02                    |
| 100 000 0.875% NRW Bank 12/04/2034                                      | 79 187              | 0,02                    |
| 100 000 0.100% NRW Bank 09/07/2035                                      | 69 242              | 0,01                    |
| 100 000 2.750% NTPC Ltd 01/02/2027                                      | 91 786              | 0,02                    |
| 100 000 0.010% NTT Finance Corp 03/03/2025                              | 93 512              | 0,02                    |
| 100 000 0.625% Nykredit Realkredit AS<br>17/01/2025                     | 94 085              | 0,02                    |
| 100 000 0.500% Nykredit Realkredit AS<br>10/07/2025                     | 92 501              | 0,02                    |
| 100 000 5.500% Nykredit Realkredit AS<br>29/12/2032                     | 99 401              | 0,02                    |
| 100 000 3.500% OeBB-Infrastruktur AG<br>19/10/2026                      | 101 254             | 0,02                    |
| 50 000 3.375% OeBB-Infrastruktur AG<br>18/05/2032                       | 51 366              | 0,01                    |
| 100 000 3.000% OeBB-Infrastruktur AG<br>24/10/2033                      | 99 637              | 0,02                    |
| 100 000 0.125% Oma Saastopankki Oyj<br>03/04/2024                       | 96 505              | 0,02                    |
| 100 000 1.500% OMV AG 09/04/2024  | 97 997              | 0,02                    |
| 100 000 1.875% OMV AG 04/12/2028  | 92 537              | 0,02                    |
| 60 000 0.750% OMV AG 16/06/2030   | 49 651              | 0,01                    |
| 100 000 2.500% OMV AG (Perpetual)                                       | 88 698              | 0,02                    |
| 100 000 1.000% OP Corporate Bank plc<br>22/05/2025                      | 94 555              | 0,02                    |
| 100 000 0.250% OP Corporate Bank plc<br>24/03/2026                      | 89 322              | 0,02                    |
| 100 000 4.125% OP Corporate Bank plc<br>18/04/2027                      | 100 933             | 0,02                    |
| 100 000 0.375% OP Corporate Bank plc<br>08/12/2028                      | 80 417              | 0,02                    |

| Participation Investissement   | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|--|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>                      |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b>                |                     |                         |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>  |                     |                         |
| 100 000 1.625% OP Corporate Bank plc<br>09/06/2030                                     | 92 191              | 0,02                    |
| 200 000 0.750% OP Mortgage Bank 07/06/2027   | 181 192             | 0,04                    |
| 100 000 1.000% OP Mortgage Bank 05/10/2027   | 91 022              | 0,02                    |
| 100 000 1.000% Optus Finance Pty Ltd 20/06/2029  | 82 266              | 0,02                    |
| 100 000 0.000% Orange SA 29/06/2026  | 89 422              | 0,02                    |
| 100 000 1.500% Orange SA 09/09/2027  | 92 172              | 0,02                    |
| 200 000 2.000% Orange SA 15/01/2029  | 184 212             | 0,04                    |
| 200 000 1.375% Orange SA 16/01/2030  | 172 780             | 0,04                    |
| 100 000 1.875% Orange SA 12/09/2030  | 88 560              | 0,02                    |
| 100 000 3.625% Orange SA 16/11/2031  | 99 620              | 0,02                    |
| 100 000 1.750% Orange SA (Perpetual)   | 83 500              | 0,02                    |
| 100 000 2.750% Orano SA 08/03/2028   | 92 328              | 0,02                    |
| 100 000 3.625% Orsted AS 01/03/2026  | 100 586             | 0,02                    |
| 100 000 3.750% Orsted AS 01/03/2030  | 100 926             | 0,02                    |
| 200 000 2.875% Orsted AS 14/06/2033  | 184 582             | 0,04                    |
| 100 000 4.125% Orsted AS 01/03/2035  | 101 865             | 0,02                    |
| 100 000 1.250% PartnerRe Ireland Finance DAC<br>15/09/2026                             | 91 353              | 0,02                    |
| 100 000 0.500% PepsiCo Inc 06/05/2028  | 87 136              | 0,02                    |
| 100 000 0.400% PepsiCo Inc 09/10/2032  | 75 875              | 0,01                    |
| 100 000 1.050% PepsiCo Inc 09/10/2050  | 60 416              | 0,01                    |
| 100 000 1.500% Pernod Ricard SA 18/05/2026   | 94 176              | 0,02                    |
| 100 000 3.250% Pernod Ricard SA 02/11/2028   | 98 965              | 0,02                    |
| 100 000 3.750% Pernod Ricard SA 02/11/2032   | 101 005             | 0,02                    |
| 100 000 2.875% Perusahaan Perseroan Persero<br>PT Perusahaan Listrik Negara 25/10/2025 | 96 314              | 0,02                    |
| 100 000 2.875% Philip Morris International Inc<br>30/05/2024                           | 99 016              | 0,02                    |
| 100 000 0.800% Philip Morris International Inc<br>01/08/2031                           | 73 247              | 0,01                    |
| 100 000 3.125% Philip Morris International Inc<br>03/06/2033                           | 86 896              | 0,02                    |
| 100 000 0.000% Poste Italiane SpA 10/12/2024   | 93 669              | 0,02                    |
| 100 000 0.875% PPG Industries Inc 03/11/2025   | 93 646              | 0,02                    |
| 100 000 0.625% Procter & Gamble Co 30/10/2024  | 96 133              | 0,02                    |
| 200 000 0.350% Procter & Gamble Co 05/05/2030  | 164 740             | 0,03                    |
| 100 000 4.250% Programa Cedulas TDA Fondo de<br>Titulizacion de Activos 28/03/2027     | 102 964             | 0,02                    |
| 100 000 4.250% Programa Cedulas TDA Fondo de<br>Titulizacion de Activos 10/04/2031     | 106 163             | 0,02                    |
| 100 000 3.875% Prologis Euro Finance LLC<br>31/01/2030                                 | 95 538              | 0,02                    |
| 100 000 0.625% Prologis Euro Finance LLC<br>10/09/2031                                 | 71 904              | 0,01                    |
| 100 000 1.500% Prologis Euro Finance LLC<br>10/09/2049                                 | 52 628              | 0,01                    |



## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>          |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b>    |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 125 000 0.875% Prologis International Funding II SA 09/07/2029             | 98 061           | 0,02              |
| 100 000 1.985% Prosus NV 13/07/2033  | 69 121           | 0,01              |
| 100 000 2.778% Prosus NV 19/01/2034  | 73 885           | 0,01              |
| 100 000 0.625% PSA Banque France SA 21/06/2024                             | 96 344           | 0,02              |
| 100 000 0.875% Public Storage 24/01/2032                                   | 71 049           | 0,01              |
| 100 000 1.500% Raiffeisen Bank International AG 12/03/2030                 | 82 302           | 0,02              |
| 100 000 2.875% Raiffeisen Bank International AG 18/06/2032                 | 77 551           | 0,02              |
| 100 000 7.375% Raiffeisen Bank International AG 20/12/2032                 | 96 861           | 0,02              |
| 100 000 0.875% Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG 30/01/2029   | 87 302           | 0,02              |
| 100 000 2.375% Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG 31/08/2032   | 92 441           | 0,02              |
| 100 000 0.375% Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG 15/01/2035   | 70 883           | 0,01              |
| 100 000 0.500% Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG 22/01/2035          | 72 178           | 0,01              |
| 100 000 2.375% Raiffeisen-Landesbank Steiermark AG 14/06/2028              | 95 642           | 0,02              |
| 100 000 4.125% RCI Banque SA 01/12/2025                                    | 99 964           | 0,02              |
| 50 000 1.750% RCI Banque SA 10/04/2026                                     | 46 408           | 0,01              |
| 70 000 4.875% RCI Banque SA 21/09/2028                                     | 70 293           | 0,01              |
| 100 000 0.750% Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV 19/05/2030 | 83 853           | 0,02              |
| 100 000 0.375% Red Electrica Financiaciones SAU 24/07/2028                 | 87 324           | 0,02              |
| 100 000 0.500% RELX Finance BV 10/03/2028                                  | 87 100           | 0,02              |
| 200 000 0.500% Rentokil Initial PLC 14/10/2028                             | 165 858          | 0,03              |
| 100 000 0.875% Repsol Europe Finance Sarl 06/07/2033                       | 75 359           | 0,01              |
| 100 000 0.125% Repsol International Finance BV 05/10/2024                  | 95 282           | 0,02              |
| 100 000 2.500% Repsol International Finance BV (Perpetual)                 | 87 095           | 0,02              |
| 100 000 1.125% Richemont International Holding SA 26/05/2032               | 82 366           | 0,02              |
| 100 000 2.000% Richemont International Holding SA 26/03/2038               | 79 953           | 0,02              |
| 100 000 1.750% Robert Bosch GmbH 08/07/2024                                | 98 239           | 0,02              |
| 100 000 3.204% Roche Finance Europe BV 27/08/2029                          | 100 325          | 0,02              |
| 100 000 0.125% Royal Bank of Canada 23/07/2024                             | 95 457           | 0,02              |
| 100 000 0.125% Royal Bank of Canada 25/03/2025                             | 93 624           | 0,02              |

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 200 000 0.625% Royal Bank of Canada 10/09/2025                          | 187 006          | 0,04              |
| 200 000 0.125% Royal Bank of Canada 26/04/2027                          | 175 762          | 0,04              |
| 100 000 1.500% Royal Schiphol Group NV 05/11/2030                       | 86 085           | 0,02              |
| 100 000 1.625% RTE Réseau de Transport d'Electricite SADR 08/10/2024    | 97 071           | 0,02              |
| 100 000 0.000% RTE Réseau de Transport d'Electricite SADR 09/09/2027    | 86 749           | 0,02              |
| 100 000 0.750% RTE Réseau de Transport d'Electricite SADR 12/01/2034    | 75 572           | 0,01              |
| 100 000 1.125% RTE Réseau de Transport d'Electricite SADR 08/07/2040    | 68 258           | 0,01              |
| 100 000 0.500% RWE AG 26/11/2028  | 84 214           | 0,02              |
| 100 000 0.625% RWE AG 11/06/2031  | 77 056           | 0,02              |
| 100 000 0.875% Ryanair DAC 25/05/2026                                   | 91 180           | 0,02              |
| 100 000 0.125% Safran SA 16/03/2026                                     | 90 704           | 0,02              |
| 100 000 2.250% Sagax AB 13/03/2025                                      | 94 094           | 0,02              |
| 100 000 3.375% Sampo Oyj 23/05/2049                                     | 88 956           | 0,02              |
| 100 000 3.750% Sandvik AB 27/09/2029                                    | 100 118          | 0,02              |
| 100 000 1.000% Sanofi 01/04/2025  | 95 749           | 0,02              |
| 100 000 0.875% Sanofi 21/03/2029  | 87 935           | 0,02              |
| 200 000 1.250% Sanofi 06/04/2029  | 179 416          | 0,04              |
| 100 000 1.375% Sanofi 21/03/2030  | 88 712           | 0,02              |
| 100 000 0.050% Santander Consumer Bank AG 14/02/2030                    | 81 700           | 0,02              |
| 100 000 0.125% Santander Consumer Bank AS 25/02/2025                    | 92 770           | 0,02              |
| 100 000 0.375% Santander Consumer Finance SA 17/01/2025                 | 94 057           | 0,02              |
| 100 000 3.530% Santander UK Group Holdings PLC 25/08/2028               | 94 516           | 0,02              |
| 100 000 0.603% Santander UK Group Holdings PLC 13/09/2029               | 79 697           | 0,02              |
| 100 000 1.250% Santander UK PLC 18/09/2024                              | 96 670           | 0,02              |
| 100 000 0.500% Santander UK PLC 10/01/2025                              | 94 771           | 0,02              |
| 200 000 1.250% SAP SE 10/03/2028  | 182 458          | 0,04              |
| 100 000 0.375% SAP SE 18/05/2029  | 84 852           | 0,02              |
| 200 000 0.750% SBB Treasury Oyj 14/12/2028                              | 112 630          | 0,02              |
| 100 000 2.250% Scentre Group Trust 1 16/07/2024                         | 96 756           | 0,02              |
| 100 000 1.375% Schlumberger Finance BV 28/10/2026                       | 93 009           | 0,02              |
| 100 000 0.250% Schlumberger Finance BV 15/10/2027                       | 86 814           | 0,02              |
| 100 000 0.875% Schneider Electric SE 11/03/2025                         | 95 790           | 0,02              |
| 100 000 1.500% Schneider Electric SE 15/01/2028                         | 92 573           | 0,02              |
| 100 000 3.375% Schneider Electric SE 13/04/2034                         | 98 554           | 0,02              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 0.250% Securitas AB 22/02/2028                                  | 82 611           | 0,02              | 100 000 0.625% Societe Generale SA 02/12/2027                           | 86 615           | 0,02              |
| 100 000 0.500% Segro Capital Sarl 22/09/2031                            | 67 782           | 0,01              | 100 000 1.375% Societe Generale SA 13/01/2028                           | 87 061           | 0,02              |
| 100 000 3.500% SES SA 14/01/2029  | 89 688           | 0,02              | 100 000 1.750% Societe Generale SA 22/03/2029                           | 86 098           | 0,02              |
| 100 000 0.375% Shell International Finance BV 15/02/2025                | 94 703           | 0,02              | 100 000 2.625% Societe Generale SA 30/05/2029                           | 93 925           | 0,02              |
| 100 000 1.625% Shell International Finance BV 20/01/2027                | 94 434           | 0,02              | 100 000 4.250% Societe Generale SA 06/12/2030                           | 96 337           | 0,02              |
| 100 000 1.500% Shell International Finance BV 07/04/2028                | 91 273           | 0,02              | 100 000 4.250% Societe Generale SA 16/11/2032                           | 102 736          | 0,02              |
| 100 000 0.750% Shell International Finance BV 15/08/2028                | 87 103           | 0,02              | 200 000 2.000% Societe Generale SFH SA 29/04/2024                       | 197 042          | 0,04              |
| 100 000 1.250% Shell International Finance BV 11/11/2032                | 80 458           | 0,02              | 200 000 0.500% Societe Generale SFH SA 28/01/2026                       | 185 038          | 0,04              |
| 200 000 0.000% Siemens Financieringsmaatschappij NV 20/02/2026          | 182 630          | 0,04              | 100 000 0.125% Societe Generale SFH SA 02/02/2029                       | 83 851           | 0,02              |
| 100 000 0.375% Siemens Financieringsmaatschappij NV 05/06/2026          | 91 429           | 0,02              | 200 000 0.010% Societe Generale SFH SA 11/02/2030                       | 161 110          | 0,03              |
| 100 000 0.625% Siemens Financieringsmaatschappij NV 25/02/2027          | 90 521           | 0,02              | 200 000 1.000% Sodexo SA 27/04/2029                                     | 174 796          | 0,04              |
| 100 000 0.250% Siemens Financieringsmaatschappij NV 20/02/2029          | 84 362           | 0,02              | 100 000 1.850% Southern Power Co 20/06/2026                             | 94 356           | 0,02              |
| 100 000 1.000% Siemens Financieringsmaatschappij NV 25/02/2030          | 85 751           | 0,02              | 100 000 0.500% SpareBank 1 Boligkreditt AS 30/01/2025                   | 94 877           | 0,02              |
| 100 000 3.625% Siemens Financieringsmaatschappij NV 24/02/2043          | 97 224           | 0,02              | 100 000 0.125% SpareBank 1 Boligkreditt AS 14/05/2026                   | 90 612           | 0,02              |
| 100 000 2.000% Signify NV 11/05/2024                                    | 97 932           | 0,02              | 200 000 1.750% SpareBank 1 Boligkreditt AS 25/05/2027                   | 188 302          | 0,04              |
| 100 000 3.250% Skandinaviska Enskilda Banken AB 24/11/2025              | 98 460           | 0,02              | 100 000 0.125% SpareBank 1 Boligkreditt AS 05/11/2029                   | 81 693           | 0,02              |
| 100 000 0.375% Skandinaviska Enskilda Banken AB 09/02/2026              | 92 073           | 0,02              | 100 000 1.750% SpareBank 1 Boligkreditt AS 11/05/2032                   | 88 085           | 0,02              |
| 100 000 1.750% Skandinaviska Enskilda Banken AB 11/11/2026              | 93 337           | 0,02              | 100 000 1.750% Sparebank 1 Oestlandet 27/04/2027                        | 92 095           | 0,02              |
| 200 000 0.750% Skandinaviska Enskilda Banken AB 09/08/2027              | 173 220          | 0,04              | 100 000 0.010% SpareBank 1 SMN 18/02/2028                               | 81 851           | 0,02              |
| 100 000 0.750% Skandinaviska Enskilda Banken AB 15/11/2027              | 89 601           | 0,02              | 100 000 0.375% SpareBank 1 SR-Bank ASA 15/07/2027                       | 87 512           | 0,02              |
| 50 000 2.500% Sky Ltd 15/09/2026  | 48 261           | 0,01              | 100 000 0.500% Sparebanken Soer Boligkreditt AS 06/02/2026              | 92 285           | 0,02              |
| 100 000 1.000% Smurfit Kappa Treasury ULC 22/09/2033                    | 73 600           | 0,01              | 200 000 0.010% Sparebanken Vest Boligkreditt AS 24/11/2025              | 183 402          | 0,04              |
| 100 000 0.000% Snam SpA 15/08/2025                                      | 92 085           | 0,02              | 200 000 0.010% SR-Boligkreditt AS 08/09/2028                            | 168 362          | 0,03              |
| 100 000 1.250% Snam SpA 20/06/2034                                      | 74 063           | 0,01              | 100 000 0.875% SSE PLC 06/09/2025                                       | 93 997           | 0,02              |
| 100 000 1.000% Snam SpA 12/09/2034                                      | 70 731           | 0,01              | 100 000 1.750% SSE PLC 16/04/2030                                       | 87 311           | 0,02              |
| 100 000 1.125% SNCF Reseau 25/05/2030                                   | 87 533           | 0,02              | 100 000 0.125% Stadshypotek AB 05/10/2026                               | 89 668           | 0,02              |
| 100 000 0.125% Societe Generale SA 24/02/2026                           | 90 052           | 0,02              | 100 000 0.010% Stadshypotek AB 24/11/2028                               | 83 629           | 0,02              |
| 100 000 0.875% Societe Generale SA 01/07/2026                           | 89 978           | 0,02              | 100 000 2.625% Stadshypotek AB 27/09/2029                               | 96 577           | 0,02              |
| 100 000 0.125% Societe Generale SA 17/11/2026                           | 90 491           | 0,02              | 100 000 0.850% Standard Chartered PLC 27/01/2028                        | 87 214           | 0,02              |
| 100 000 0.750% Societe Generale SA 25/01/2027                           | 88 019           | 0,02              | 100 000 2.500% Standard Chartered PLC 09/09/2030                        | 93 705           | 0,02              |
| 200 000 0.250% Societe Generale SA 08/07/2027                           | 171 798          | 0,04              | 100 000 1.375% State Grid Overseas Investment BVI Ltd 02/05/2025        | 94 474           | 0,02              |
| 100 000 4.000% Societe Generale SA 16/11/2027                           | 100 495          | 0,02              | 100 000 1.750% State Grid Overseas Investment BVI Ltd 19/05/2025        | 95 129           | 0,02              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets | Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                     |                         | <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                     |                         | <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                     |                         | <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 100 000 2.875% Statkraft AS 13/09/2029                                  | 97 778              | 0,02                    | 100 000 1.201% Telefonica Emisiones SA 21/08/2027                       | 90 759              | 0,02                    |
| 100 000 0.875% Stedin Holding NV 24/10/2025                             | 93 595              | 0,02                    | 100 000 1.715% Telefonica Emisiones SA 12/01/2028                       | 92 272              | 0,02                    |
| 100 000 2.375% Stedin Holding NV 03/06/2030                             | 93 049              | 0,02                    | 100 000 2.932% Telefonica Emisiones SA 17/10/2029                       | 95 674              | 0,02                    |
| 400 000 3.875% Stellantis NV 05/01/2026                                 | 401 068             | 0,08                    | 100 000 1.807% Telefonica Emisiones SA 21/05/2032                       | 84 254              | 0,02                    |
| 100 000 0.250% Stryker Corp 03/12/2024                                  | 94 843              | 0,02                    | 100 000 1.957% Telefonica Emisiones SA 01/07/2039                       | 73 715              | 0,01                    |
| 100 000 2.875% Suez SACA 24/05/2034                                     | 87 536              | 0,02                    | 100 000 0.250% Telenor ASA 14/02/2028                                   | 84 875              | 0,02                    |
| 100 000 0.267% Sumitomo Mitsui Banking Corp 18/06/2026                  | 89 727              | 0,02                    | 100 000 1.750% Telenor ASA 31/05/2034                                   | 80 884              | 0,02                    |
| 100 000 0.409% Sumitomo Mitsui Banking Corp 07/11/2029                  | 81 752              | 0,02                    | 100 000 1.875% Teleperformance 02/07/2025                               | 93 783              | 0,02                    |
| 100 000 0.303% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 28/10/2027           | 83 644              | 0,02                    | 100 000 3.000% Telia Co AB 07/09/2027                                   | 97 306              | 0,02                    |
| 100 000 0.010% Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd 15/10/2027                | 85 092              | 0,02                    | 100 000 2.125% Telia Co AB 20/02/2034                                   | 83 521              | 0,02                    |
| 100 000 0.125% Svenska Handelsbanken AB 18/06/2024                      | 95 854              | 0,02                    | 100 000 1.375% Telstra Corp Ltd 26/03/2029                              | 87 282              | 0,02                    |
| 100 000 0.125% Svenska Handelsbanken AB 03/11/2026                      | 88 526              | 0,02                    | 150 000 1.250% Temasek Financial I Ltd 20/11/2049                       | 95 137              | 0,02                    |
| 100 000 3.750% Svenska Handelsbanken AB 01/11/2027                      | 99 914              | 0,02                    | 100 000 1.625% TenneT Holding BV 17/11/2026                             | 95 498              | 0,02                    |
| 100 000 1.375% Svenska Handelsbanken AB 23/02/2029                      | 85 318              | 0,02                    | 100 000 3.875% TenneT Holding BV 28/10/2028                             | 102 387             | 0,02                    |
| 200 000 0.010% Sveriges Sakerstallda Obligationer AB 14/03/2030         | 160 674             | 0,03                    | 100 000 2.125% TenneT Holding BV 17/11/2029                             | 93 679              | 0,02                    |
| 100 000 0.300% Swedbank AB 20/05/2027                                   | 87 951              | 0,02                    | 100 000 4.250% TenneT Holding BV 28/04/2032                             | 104 327             | 0,02                    |
| 100 000 0.200% Swedbank AB 12/01/2028                                   | 82 486              | 0,02                    | 100 000 2.375% TenneT Holding BV 17/05/2033                             | 91 869              | 0,02                    |
| 100 000 0.050% Swedbank Hypotek AB 28/05/2025                           | 93 121              | 0,02                    | 100 000 0.875% TenneT Holding BV 16/06/2035                             | 77 192              | 0,02                    |
| 100 000 0.500% Swedbank Hypotek AB 05/02/2026                           | 92 434              | 0,02                    | 100 000 0.875% Terega SA 17/09/2030                                     | 78 790              | 0,02                    |
| 100 000 1.375% Swedbank Hypotek AB 31/05/2027                           | 92 892              | 0,02                    | 200 000 0.375% Tema - Rete Elettrica Nazionale 23/06/2029               | 164 084             | 0,03                    |
| 100 000 0.500% Swiss Life Finance I Ltd 15/09/2031                      | 74 386              | 0,01                    | 100 000 2.500% Tesco Corporate Treasury Services PLC 01/07/2024         | 98 714              | 0,02                    |
| 100 000 4.750% Sydbank AS 30/09/2025                                    | 99 609              | 0,02                    | 100 000 0.750% Thales SA 23/01/2025                                     | 95 109              | 0,02                    |
| 100 000 3.375% Syngenta Finance NV 16/04/2026                           | 96 914              | 0,02                    | 100 000 1.250% Thames Water Utilities Finance PLC 31/01/2032            | 77 336              | 0,02                    |
| 100 000 2.250% Takeda Pharmaceutical Co Ltd 21/11/2026                  | 95 532              | 0,02                    | 100 000 1.625% Thermo Fisher Scientific Finance I BV 18/10/2041         | 69 700              | 0,01                    |
| 100 000 1.000% Takeda Pharmaceutical Co Ltd 09/07/2029                  | 85 037              | 0,02                    | 100 000 0.750% Thermo Fisher Scientific Inc 12/09/2024                  | 96 204              | 0,02                    |
| 100 000 3.000% Takeda Pharmaceutical Co Ltd 21/11/2030                  | 94 771              | 0,02                    | 100 000 2.000% Thermo Fisher Scientific Inc 15/04/2025                  | 97 069              | 0,02                    |
| 100 000 4.000% Talanx AG 25/10/2029                                     | 100 886             | 0,02                    | 100 000 3.200% Thermo Fisher Scientific Inc 21/01/2026                  | 99 553              | 0,02                    |
| 100 000 2.250% Talanx AG 05/12/2047                                     | 86 424              | 0,02                    | 100 000 0.875% Thermo Fisher Scientific Inc 01/10/2031                  | 80 337              | 0,02                    |
| 100 000 2.500% TDF Infrastructure SASU 07/04/2026                       | 94 041              | 0,02                    | 100 000 3.650% Thermo Fisher Scientific Inc 21/11/2034                  | 99 428              | 0,02                    |
| 100 000 1.125% Tele2 AB 15/05/2024                                      | 96 920              | 0,02                    | 100 000 1.500% Thermo Fisher Scientific Inc 01/10/2039                  | 71 574              | 0,01                    |
| 100 000 1.000% Telefonaktiebolaget LM Ericsson 26/05/2029               | 78 335              | 0,02                    | 200 000 0.500% Toronto-Dominion Bank 03/04/2024                         | 194 280             | 0,04                    |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 1.707% Toronto-Dominion Bank 28/07/2025                         | 96 109           | 0,02              | 100 000 0.010% UniCredit Bank AG 10/09/2024                             | 95 278           | 0,02              |
| 100 000 0.100% Toronto-Dominion Bank 19/07/2027                         | 87 024           | 0,02              | 200 000 3.125% UniCredit Bank AG 20/08/2025                             | 199 422          | 0,04              |
| 100 000 2.551% Toronto-Dominion Bank 03/08/2027                         | 93 819           | 0,02              | 100 000 0.010% UniCredit Bank AG 19/11/2027                             | 86 815           | 0,02              |
| 100 000 3.129% Toronto-Dominion Bank 03/08/2032                         | 92 007           | 0,02              | 100 000 0.010% UniCredit Bank AG 10/03/2031                             | 78 676           | 0,02              |
| 100 000 0.625% TotalEnergies Capital International SA 04/10/2024        | 96 324           | 0,02              | 100 000 0.250% UniCredit Bank AG 15/01/2032                             | 78 372           | 0,02              |
| 100 000 1.375% TotalEnergies Capital International SA 19/03/2025        | 96 859           | 0,02              | 100 000 0.850% UniCredit Bank AG 22/05/2034                             | 78 597           | 0,02              |
| 100 000 2.875% TotalEnergies Capital International SA 19/11/2025        | 99 146           | 0,02              | 100 000 0.250% UniCredit Bank Austria AG 04/06/2027                     | 88 361           | 0,02              |
| 100 000 1.491% TotalEnergies Capital International SA 08/04/2027        | 93 125           | 0,02              | 100 000 3.125% UniCredit Bank Austria AG 21/09/2029                     | 99 359           | 0,02              |
| 100 000 1.491% TotalEnergies Capital International SA 04/09/2030        | 86 870           | 0,02              | 100 000 0.500% UniCredit SpA 09/04/2025                                 | 93 631           | 0,02              |
| 200 000 1.994% TotalEnergies Capital International SA 08/04/2032        | 175 092          | 0,04              | 100 000 1.250% UniCredit SpA 25/06/2025                                 | 96 492           | 0,02              |
| 100 000 1.618% TotalEnergies Capital International SA 18/05/2040        | 70 472           | 0,01              | 100 000 0.325% UniCredit SpA 19/01/2026                                 | 90 528           | 0,02              |
| 100 000 1.750% TotalEnergies SE (Perpetual) 09/04/2024                  | 96 003           | 0,02              | 100 000 1.250% UniCredit SpA 16/06/2026                                 | 93 712           | 0,02              |
| 100 000 0.250% Toyota Finance Australia Ltd 05/11/2027                  | 85 987           | 0,02              | 100 000 0.925% UniCredit SpA 18/01/2028                                 | 87 735           | 0,02              |
| 100 000 0.125% Toyota Motor Credit Corp 13/09/2029                      | 102 797          | 0,02              | 200 000 4.450% UniCredit SpA 16/02/2029                                 | 192 734          | 0,04              |
| 100 000 4.050% Toyota Motor Credit Corp Netherlands BV 27/10/2025       | 91 445           | 0,02              | 100 000 0.500% Unilever Finance Netherlands BV 06/01/2025               | 95 142           | 0,02              |
| 100 000 1.750% Transurban Finance Co Pty Ltd 29/03/2028                 | 90 711           | 0,02              | 100 000 1.750% Unilever Finance Netherlands BV 16/11/2028               | 92 221           | 0,02              |
| 200 000 0.125% Traton Finance Luxembourg SA 24/03/2025                  | 185 984          | 0,04              | 100 000 1.250% Unilever Finance Netherlands BV 28/02/2031               | 86 043           | 0,02              |
| 100 000 0.000% Tyco Electronics Group SA 16/02/2029                     | 80 763           | 0,02              | 100 000 2.250% Unilever Finance Netherlands BV 16/05/2034               | 89 927           | 0,02              |
| 200 000 0.010% UBS AG/London 31/03/2026                                 | 178 052          | 0,04              | 100 000 0.500% United Overseas Bank Ltd 16/01/2025                      | 94 759           | 0,02              |
| 400 000 0.250% UBS Group AG 03/11/2026                                  | 357 072          | 0,07              | 100 000 0.387% United Overseas Bank Ltd 17/03/2025                      | 94 093           | 0,02              |
| 200 000 2.750% UBS Group AG 15/06/2027                                  | 188 714          | 0,04              | 100 000 1.625% United Parcel Service Inc 15/11/2025                     | 95 948           | 0,02              |
| 200 000 0.625% UBS Group AG 24/02/2033                                  | 139 032          | 0,03              | 100 000 1.362% Upjohn Finance BV 23/06/2027                             | 88 477           | 0,02              |
| 300 000 1.000% Unibail-Rodamco-Westfield SE 27/02/2027                  | 261 297          | 0,05              | 100 000 1.908% Upjohn Finance BV 23/06/2032                             | 76 987           | 0,02              |
| 100 000 0.750% Unibail-Rodamco-Westfield SE 25/10/2028                  | 79 547           | 0,02              | 100 000 0.125% UPM-Kymmene Oyj 19/11/2028                               | 82 621           | 0,02              |
| 100 000 1.375% Unibail-Rodamco-Westfield SE 04/12/2031                  | 74 031           | 0,01              | 100 000 0.850% US Bancorp 07/06/2024                                    | 95 829           | 0,02              |
| 100 000 1.750% Unibail-Rodamco-Westfield SE 27/02/2034                  | 74 146           | 0,01              | 100 000 0.125% Vattenfall AB 12/02/2029                                 | 83 397           | 0,02              |
| 100 000 1.875% UniCredit Bank AG 09/04/2024                             | 98 414           | 0,02              | 100 000 0.000% Veolia Environnement SA 09/06/2026                       | 89 928           | 0,02              |
|   |                  |                   | 100 000 1.496% Veolia Environnement SA 30/11/2026                       | 93 757           | 0,02              |
|   |                  |                   | 100 000 1.625% Veolia Environnement SA 17/09/2030                       | 87 703           | 0,02              |
|   |                  |                   | 100 000 0.500% Veolia Environnement SA 14/10/2031                       | 77 864           | 0,02              |
|   |                  |                   | 200 000 0.800% Veolia Environnement SA 15/01/2032                       | 157 510          | 0,03              |
|   |                  |                   | 100 000 1.250% Veolia Environnement SA 14/05/2035                       | 76 543           | 0,01              |
|   |                  |                   | 100 000 0.900% Verbund AG 01/04/2041                                    | 67 474           | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR   | % des<br>actifs<br>nets | Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets                                   |         |      |
|---|---|-------------------------|---|---------------------|---|---------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |   |                         | <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                     |   |         |      |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |   |                         | <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                     |   |         |      |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |   |                         | <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                     |   |         |      |
| 100 000   | 1.375% Verizon Communications Inc<br>27/10/2026                           | 92 913                  | 0,02  | 100 000             | 4.625% Volkswagen International Finance<br>NV (Perpetual) | 96 027  | 0,02 |
| 100 000   | 2.625% Verizon Communications Inc<br>01/12/2031                           | 91 541                  | 0,02  | 100 000             | 3.500% Volkswagen International Finance<br>NV (Perpetual) | 83 529  | 0,02 |
| 200 000   | 0.875% Verizon Communications Inc<br>19/03/2032                           | 154 660                 | 0,03  | 100 000             | 3.375% Volkswagen International Finance<br>NV (Perpetual) | 96 495  | 0,02 |
| 200 000   | 1.300% Verizon Communications Inc<br>18/05/2033                           | 156 800                 | 0,03  | 100 000             | 3.500% Volkswagen International Finance<br>NV (Perpetual) | 94 301  | 0,02 |
| 100 000   | 4.750% Verizon Communications Inc<br>31/10/2034                           | 106 598                 | 0,02  | 100 000             | 3.875% Volkswagen International Finance<br>NV (Perpetual) | 85 725  | 0,02 |
| 100 000   | 2.875% Verizon Communications Inc<br>15/01/2038                           | 86 244                  | 0,02  | 100 000             | 4.625% Volkswagen International Finance<br>NV (Perpetual) | 91 037  | 0,02 |
| 100 000   | 2.000% Vesteda Finance BV 10/07/2026                                      | 93 238                  | 0,02  | 50 000              | 0.250% Volkswagen Leasing GmbH<br>12/01/2026              | 49 895  | 0,01 |
| 50 000  | 3.750% Vienna Insurance Group AG<br>Wiener Versicherung Gruppe 02/03/2046 | 47 415                  | 0,01  | 100 000             | 1.500% Volkswagen Leasing GmbH<br>19/06/2026              | 92 987  | 0,02 |
| 100 000   | 2.875% Vier Gas Transport GmbH<br>12/06/2025                              | 97 684                  | 0,02  | 100 000             | 0.375% Volkswagen Leasing GmbH<br>20/07/2026              | 89 359  | 0,02 |
| 100 000   | 0.500% Vier Gas Transport GmbH<br>10/09/2034                              | 67 627                  | 0,01  | 35 000              | 0.500% Volkswagen Leasing GmbH<br>12/01/2029              | 28 399  | 0,00 |
| 100 000   | 1.625% Vinci SA 18/01/2029  | 90 947                  | 0,02  | 100 000             | 0.125% Volvo Treasury AB 17/09/2024                       | 95 142  | 0,02 |
| 100 000   | 0.500% Vinci SA 09/01/2032  | 77 911                  | 0,02  | 100 000             | 1.625% Volvo Treasury AB 26/05/2025                       | 96 031  | 0,02 |
| 100 000   | 4.625% Virgin Money UK PLC 29/10/2028                                     | 95 370                  | 0,02  | 200 000             | 1.500% Vonovia Finance BV 10/06/2026                      | 180 342 | 0,04 |
| 100 000   | 1.500% Visa Inc 15/06/2026  | 94 258                  | 0,02  | 100 000             | 0.625% Vonovia Finance BV 09/07/2026                      | 87 006  | 0,02 |
| 100 000   | 0.625% Vivendi SE 11/06/2025  | 93 569                  | 0,02  | 100 000             | 1.750% Vonovia Finance BV 25/01/2027                      | 88 450  | 0,02 |
| 100 000   | 2.200% Vodafone Group PLC 25/08/2026                                      | 96 568                  | 0,02  | 100 000             | 2.125% Vonovia Finance BV 22/03/2030                      | 79 976  | 0,02 |
| 100 000   | 0.900% Vodafone Group PLC 24/11/2026                                      | 92 161                  | 0,02  | 100 000             | 0.000% Vonovia SE 01/12/2025                              | 88 118  | 0,02 |
| 100 000   | 1.600% Vodafone Group PLC 29/07/2031                                      | 84 544                  | 0,02  | 100 000             | 4.750% Vonovia SE 23/05/2027                              | 97 863  | 0,02 |
| 100 000   | 2.500% Vodafone Group PLC 24/05/2039                                      | 78 905                  | 0,02  | 100 000             | 0.375% Vonovia SE 16/06/2027                              | 81 514  | 0,02 |
| 100 000   | 1.250% Volkswagen Bank GmbH<br>15/12/2025                                 | 93 683                  | 0,02  | 100 000             | 1.500% Vonovia SE 14/06/2041                              | 52 714  | 0,01 |
| 100 000   | 2.500% Volkswagen Bank GmbH<br>31/07/2026                                 | 95 214                  | 0,02  | 100 000             | 0.500% Vseobecna Uverova Banka AS<br>26/06/2029           | 83 495  | 0,02 |
| 140 000   | 0.000% Volkswagen Financial Services<br>AG 12/02/2025                     | 130 903                 | 0,03  | 50 000              | 4.875% Walmart Inc 21/09/2029                             | 54 295  | 0,01 |
| 100 000   | 0.375% Volkswagen Financial Services<br>AG 12/02/2030                     | 77 218                  | 0,02  | 200 000             | 1.625% Wells Fargo & Co 02/06/2025                        | 190 438 | 0,04 |
| 100 000   | 3.125% Volkswagen International Finance<br>NV 28/03/2025                  | 98 673                  | 0,02  | 100 000             | 2.000% Wells Fargo & Co 27/04/2026                        | 94 569  | 0,02 |
| 100 000   | 1.875% Volkswagen International Finance<br>NV 30/03/2027                  | 91 977                  | 0,02  | 100 000             | 1.000% Wells Fargo & Co 02/02/2027                        | 89 362  | 0,02 |
| 100 000   | 1.625% Volkswagen International Finance<br>NV 16/01/2030                  | 88 154                  | 0,02  | 100 000             | 1.741% Wells Fargo & Co 04/05/2030                        | 86 434  | 0,02 |
| 100 000   | 3.250% Volkswagen International Finance<br>NV 18/11/2030                  | 93 498                  | 0,02  | 100 000             | 1.375% Wendel SE 26/04/2026                               | 93 010  | 0,02 |
| 100 000   | 1.250% Volkswagen International Finance<br>NV 23/09/2032                  | 77 493                  | 0,02  | 100 000             | 0.625% Westpac Banking Corp<br>22/11/2024                 | 94 863  | 0,02 |
| 100 000   | 1.500% Volkswagen International Finance<br>NV 21/01/2041                  | 64 802                  | 0,01  | 200 000             | 0.500% Westpac Banking Corp<br>16/01/2025                 | 189 524 | 0,04 |
|   |   |                         |   | 100 000             | 1.125% Westpac Banking Corp<br>05/09/2027                 | 89 779  | 0,02 |
|   |   |                         |   | 200 000             | 0.375% Westpac Banking Corp<br>22/09/2036                 | 133 174 | 0,03 |
|   |   |                         |   | 100 000             | 0.427% Westpac Securities NZ Ltd/<br>London 14/12/2026    | 88 170  | 0,02 |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR   | % des actifs nets |
|---|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>       |                    |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 36,46 % (mars 2022 : 34,86 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Euro – 36,46 % (suite)</b>   |                    |                   |
| 100 000 0.100% Westpac Securities NZ Ltd/ London 13/07/2027             | 84 497             | 0,02              |
| 100 000 0.500% Whirlpool EMEA Finance Sarl 20/02/2028                   | 85 069             | 0,02              |
| 100 000 0.840% Wintershall Dea Finance BV 25/09/2025                    | 92 344             | 0,02              |
| 100 000 1.250% Wirtschafts- und Infrastrukturbank Hessen 06/09/2033     | 84 699             | 0,02              |
| 100 000 3.000% Wolters Kluwer NV 23/09/2026                             | 98 804             | 0,02              |
| 100 000 0.750% Wolters Kluwer NV 03/07/2030                             | 82 177             | 0,02              |
| 100 000 2.250% WPC Eurobond BV 09/04/2026                               | 92 373             | 0,02              |
| 200 000 1.375% WPP Finance 2016 20/03/2025                              | 190 548            | 0,04              |
| 100 000 0.010% Wuestenrot Bausparkasse AG 20/10/2027                    | 86 948             | 0,02              |
| 100 000 0.750% Wurth Finance International BV 22/11/2027                | 88 479             | 0,02              |
| 100 000 0.125% Yorkshire Building Society 08/05/2024                    | 96 235             | 0,02              |
| 100 000 1.875% Zurich Finance Ireland Designated Activity Co 17/09/2050 | 78 668             | 0,02              |
| <b>Total des obligations d'entreprise</b>                               | <b>172 001 145</b> | <b>36,46</b>      |
| <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b>       |                    |                   |
| <b>Euro – 62,54 %</b>   |                    |                   |
| 200 000 0.375% Action Logement Services 05/10/2031                      | 159 640            | 0,03              |
| 200 000 3.500% Adif Alta Velocidad 27/05/2024                           | 200 382            | 0,04              |
| 100 000 0.950% Adif Alta Velocidad 30/04/2027                           | 91 284             | 0,02              |
| 100 000 1.375% Agence Francaise de Developpement EPIC 17/09/2024        | 97 312             | 0,02              |
| 200 000 2.250% Agence Francaise de Developpement EPIC 28/05/2026        | 194 606            | 0,04              |
| 300 000 0.250% Agence Francaise de Developpement EPIC 21/07/2026        | 273 432            | 0,06              |
| 100 000 0.000% Agence Francaise de Developpement EPIC 28/10/2027        | 86 955             | 0,02              |
| 100 000 1.000% Agence Francaise de Developpement EPIC 31/01/2028        | 90 799             | 0,02              |
| 200 000 0.125% Agence Francaise de Developpement EPIC 29/09/2031        | 155 216            | 0,03              |
| 100 000 1.375% Agence Francaise de Developpement EPIC 05/07/2032        | 85 694             | 0,02              |
| 200 000 0.375% Agence Francaise de Developpement EPIC 25/05/2036        | 135 366            | 0,03              |
| 100 000 0.000% Agence France Locale 20/09/2027                          | 87 119             | 0,02              |
| 100 000 1.125% Agence France Locale 20/06/2028                          | 90 465             | 0,02              |

| Participation Investissement   | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>          |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b>          |                  |                   |
| <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 0.250% Autobahnen- und Schnellstrassen-Finanzierungs AG 18/10/2024 | 95 462           | 0,02              |
| 100 000 1.375% Autonomous Community of Andalusia Spain 30/04/2029          | 89 426           | 0,02              |
| 50 000 4.125% Autonomous Community of Madrid Spain 21/05/2024              | 50 443           | 0,01              |
| 100 000 1.826% Autonomous Community of Madrid Spain 30/04/2025             | 97 318           | 0,02              |
| 200 000 4.300% Autonomous Community of Madrid Spain 15/09/2026             | 207 152          | 0,04              |
| 100 000 1.571% Autonomous Community of Madrid Spain 30/04/2029             | 90 806           | 0,02              |
| 100 000 0.420% Autonomous Community of Madrid Spain 30/04/2031             | 79 178           | 0,02              |
| 100 000 4.000% Bank Gospodarstwa Krajowego 08/09/2027                      | 98 657           | 0,02              |
| 100 000 1.625% Bank Gospodarstwa Krajowego 30/04/2028                      | 86 647           | 0,02              |
| 100 000 1.125% Basque Government 30/04/2029                                | 88 576           | 0,02              |
| 100 000 0.450% Basque Government 30/04/2032                                | 77 497           | 0,02              |
| 200 000 0.500% BNG Bank NV 16/04/2025                                      | 189 594          | 0,04              |
| 100 000 0.125% BNG Bank NV 11/04/2026                                      | 91 565           | 0,02              |
| 100 000 0.625% BNG Bank NV 19/06/2027                                      | 90 749           | 0,02              |
| 200 000 2.750% BNG Bank NV 04/10/2027                                      | 198 102          | 0,04              |
| 300 000 0.050% BNG Bank NV 20/11/2029                                      | 246 963          | 0,05              |
| 100 000 0.100% BNG Bank NV 15/01/2030                                      | 82 204           | 0,02              |
| 200 000 0.000% BNG Bank NV 20/01/2031                                      | 158 382          | 0,03              |
| 200 000 3.000% BNG Bank NV 11/01/2033                                      | 198 564          | 0,04              |
| 300 000 0.125% BNG Bank NV 19/04/2033                                      | 224 316          | 0,05              |
| 100 000 0.875% BNG Bank NV 17/10/2035                                      | 76 697           | 0,02              |
| 300 000 0.250% BNG Bank NV 22/11/2036                                      | 202 062          | 0,04              |
| 100 000 1.500% BNG Bank NV 15/07/2039                                      | 77 849           | 0,02              |
| 100 000 0.125% Bpifrance SACA 25/03/2025                                   | 94 229           | 0,02              |
| 100 000 2.750% Bpifrance SACA 25/10/2025                                   | 99 018           | 0,02              |
| 100 000 0.625% Bpifrance SACA 25/05/2026                                   | 92 798           | 0,02              |
| 200 000 0.875% Bpifrance SACA 25/11/2026                                   | 184 914          | 0,04              |
| 100 000 0.125% Bpifrance SACA 26/02/2027                                   | 89 311           | 0,02              |
| 100 000 1.000% Bpifrance SACA 25/05/2027                                   | 92 092           | 0,02              |
| 100 000 0.875% Bpifrance SACA 26/09/2028                                   | 88 965           | 0,02              |
| 200 000 0.050% Bpifrance SACA 26/09/2029                                   | 164 952          | 0,03              |
| 100 000 2.875% Bpifrance SACA 25/11/2029                                   | 98 804           | 0,02              |
| 300 000 0.250% Bpifrance SACA 04/06/2031                                   | 239 916          | 0,05              |
| 100 000 2.950% Bulgaria Government International Bond 03/09/2024           | 99 108           | 0,02              |
| 100 000 4,125% Bulgaria Government International Bond 23/09/2029           | 98 251           | 0,02              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>    |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b>    |                  |                   |
| <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 0.375% Bulgaria Government International Bond 23/09/2030     | 75 319           | 0,02              |
| 100 000 1.375% Bulgaria Government International Bond 23/09/2050     | 55 709           | 0,01              |
| 910 000 0.000% Bundesobligation 05/04/2024                           | 884 675          | 0,19              |
| 950 000 0.000% Bundesobligation 18/10/2024                           | 911 477          | 0,19              |
| 850 000 0.000% Bundesobligation 11/04/2025                           | 806 063          | 0,17              |
| 1 160 000 0.000% Bundesobligation 10/10/2025                         | 1 089 202        | 0,23              |
| 1 000 000 0.000% Bundesobligation 10/04/2026                         | 928 990          | 0,20              |
| 900 000 0.000% Bundesobligation 09/10/2026                           | 827 604          | 0,18              |
| 900 000 0.000% Bundesobligation 16/04/2027                           | 819 000          | 0,17              |
| 1 800 000 1.300% Bundesobligation 15/10/2027                         | 1 721 914        | 0,36              |
| 600 000 2.200% Bundesobligation 13/04/2028                           | 596 270          | 0,13              |
| 900 000 1.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/05/2024   | 887 418          | 0,19              |
| 850 000 1.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2024   | 830 178          | 0,18              |
| 1 250 000 0.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2025 | 1 201 262        | 0,25              |
| 1 245 000 1.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2025 | 1 199 831        | 0,25              |
| 1 480 000 0.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2026 | 1 399 029        | 0,30              |
| 1 360 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2026 | 1 255 008        | 0,27              |
| 1 280 000 0.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2027 | 1 181 453        | 0,25              |
| 310 000 6.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2027   | 361 175          | 0,08              |
| 1 550 000 0.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2027 | 1 433 951        | 0,30              |
| 1 150 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/11/2027 | 1 034 160        | 0,22              |
| 80 000 5.625% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/01/2028    | 91 718           | 0,02              |
| 1 110 000 0.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2028 | 1 018 469        | 0,22              |
| 105 000 4.750% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2028   | 117 491          | 0,02              |
| 820 000 0.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2028   | 736 376          | 0,16              |
| 1 200 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/11/2028 | 1 057 296        | 0,22              |
| 1 200 000 0.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2029 | 1 068 120        | 0,23              |
| 1 340 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2029 | 1 161 793        | 0,25              |
| 900 000 2.100% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/11/2029   | 889 155          | 0,19              |

| Participation Investissement   | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>    |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b>    |                  |                   |
| <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 455 000 6.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/01/2030   | 567 749          | 0,12              |
| 1 150 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2030 | 987 321          | 0,21              |
| 1 750 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2030 | 1 487 646        | 0,31              |
| 525 000 5.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/01/2031   | 644 474          | 0,14              |
| 1 100 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2031 | 924 209          | 0,20              |
| 1 550 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2031 | 1 288 739        | 0,27              |
| 1 250 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2032 | 1 026 708        | 0,22              |
| 1 100 000 1.700% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2032 | 1 048 242        | 0,22              |
| 650 000 2.300% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2033   | 649 753          | 0,14              |
| 1 065 000 4.750% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2034 | 1 316 809        | 0,28              |
| 800 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/05/2035   | 602 200          | 0,13              |
| 1 000 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/05/2036 | 732 070          | 0,15              |
| 1 140 000 4.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/01/2037 | 1 351 219        | 0,29              |
| 500 000 1.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/05/2038   | 409 464          | 0,09              |
| 700 000 4.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2039   | 869 113          | 0,18              |
| 804 000 4.750% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2040   | 1 064 174        | 0,23              |
| 730 000 3.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2042   | 820 659          | 0,17              |
| 1 200 000 2.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2044 | 1 221 768        | 0,26              |
| 1 190 000 2.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2046 | 1 220 999        | 0,26              |
| 1 420 000 1.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2048 | 1 134 621        | 0,24              |
| 1 750 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2050 | 946 101          | 0,20              |
| 740 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2052   | 380 974          | 0,08              |
| 500 000 1.800% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2053   | 439 127          | 0,09              |
| 700 000 0.200% Bundesschatzanweisungen 14/06/2024                    | 678 720          | 0,14              |
| 550 000 0.400% Bundesschatzanweisungen 13/09/2024                    | 531 854          | 0,11              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR  | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets  |         |      |
|---|---|-------------------|---|------------------|--|---------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |   |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |                  |  |         |      |
| <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |   |                   | <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |                  |  |         |      |
| <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |   |                   | <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |                  |  |         |      |
| 300 000   | 2.200% Bundesschatzanweisungen<br>12/12/2024                    | 297 318           | 0,06  | 100 000          | 0.375% Caisse Francaise de Financement<br>Local 13/02/2040 | 61 693  | 0,01 |
| 600 000   | 2.500% Bundesschatzanweisungen<br>13/03/2025                    | 597 678           | 0,13  | 100 000          | 1.500% Cassa Depositi e Prestiti SpA<br>21/06/2024         | 97 591  | 0,02 |
| 300 000   | 1.375% Caisse d'Amortissement de la<br>Dette Sociale 25/11/2024 | 291 414           | 0,06  | 200 000          | 2.125% Cassa Depositi e Prestiti SpA<br>21/03/2026         | 191 042 | 0,04 |
| 300 000   | 4.000% Caisse d'Amortissement de la<br>Dette Sociale 15/12/2025 | 307 050           | 0,06  | 100 000          | 1.625% Chile Government International<br>Bond 30/01/2025   | 96 236  | 0,02 |
| 200 000   | 0.000% Caisse d'Amortissement de la<br>Dette Sociale 25/11/2026 | 179 806           | 0,04  | 100 000          | 1.750% Chile Government International<br>Bond 20/01/2026   | 94 346  | 0,02 |
| 400 000   | 1.750% Caisse d'Amortissement de la<br>Dette Sociale 25/11/2027 | 378 940           | 0,08  | 100 000          | 0.555% Chile Government International<br>Bond 21/01/2029   | 82 586  | 0,02 |
| 200 000   | 0.000% Caisse d'Amortissement de la<br>Dette Sociale 25/02/2028 | 173 084           | 0,04  | 100 000          | 1.440% Chile Government International<br>Bond 01/02/2029   | 87 071  | 0,02 |
| 200 000   | 3.000% Caisse d'Amortissement de la<br>Dette Sociale 25/05/2028 | 200 034           | 0,04  | 100 000          | 1.250% Chile Government International<br>Bond 29/01/2040   | 66 646  | 0,01 |
| 500 000   | 0.000% Caisse d'Amortissement de la<br>Dette Sociale 25/05/2029 | 417 645           | 0,09  | 200 000          | 0.000% China Government International<br>Bond 17/11/2024   | 188 888 | 0,04 |
| 200 000   | 3.125% Caisse d'Amortissement de la<br>Dette Sociale 01/03/2030 | 201 870           | 0,04  | 100 000          | 0.125% China Government International<br>Bond 12/11/2026   | 88 754  | 0,02 |
| 300 000   | 0.000% Caisse d'Amortissement de la<br>Dette Sociale 25/11/2030 | 239 178           | 0,05  | 100 000          | 0.625% China Government International<br>Bond 17/11/2033   | 73 982  | 0,02 |
| 200 000   | 0.125% Caisse d'Amortissement de la<br>Dette Sociale 15/09/2031 | 157 722           | 0,03  | 100 000          | 0.625% China Government International<br>Bond 25/11/2035   | 70 094  | 0,01 |
| 400 000   | 0.450% Caisse d'Amortissement de la<br>Dette Sociale 19/01/2032 | 320 508           | 0,07  | 200 000          | 2.700% Croatia Government International<br>Bond 15/06/2028 | 192 592 | 0,04 |
| 100 000   | 0.750% Caisse des Depots et<br>Consignations 18/09/2028         | 88 352            | 0,02  | 100 000          | 1.125% Croatia Government International<br>Bond 19/06/2029 | 86 245  | 0,02 |
| 100 000   | 0.375% Caisse Francaise de Financement<br>Local 11/05/2024      | 96 687            | 0,02  | 100 000          | 1.500% Croatia Government International<br>Bond 17/06/2031 | 84 300  | 0,02 |
| 100 000   | 5.375% Caisse Francaise de Financement<br>Local 08/07/2024      | 102 265           | 0,02  | 200 000          | 1.125% Croatia Government International<br>Bond 04/03/2033 | 156 178 | 0,03 |
| 100 000   | 0.375% Caisse Francaise de Financement<br>Local 23/06/2025      | 93 659            | 0,02  | 100 000          | 2.750% Cyprus Government International<br>Bond 27/06/2024  | 99 893  | 0,02 |
| 200 000   | 0.625% Caisse Francaise de Financement<br>Local 13/04/2026      | 184 594           | 0,04  | 150 000          | 0.000% Cyprus Government International<br>Bond 09/02/2026  | 136 383 | 0,03 |
| 100 000   | 0.750% Caisse Francaise de Financement<br>Local 11/01/2027      | 91 156            | 0,02  | 100 000          | 1.500% Cyprus Government International<br>Bond 16/04/2027  | 92 688  | 0,02 |
| 100 000   | 3.000% Caisse Francaise de Financement<br>Local 02/10/2028      | 98 792            | 0,02  | 60 000           | 2.375% Cyprus Government International<br>Bond 25/09/2028  | 56 120  | 0,01 |
| 100 000   | 0.010% Caisse Francaise de Financement<br>Local 27/04/2029      | 82 537            | 0,02  | 60 000           | 2.750% Cyprus Government International<br>Bond 26/02/2034  | 52 343  | 0,01 |
| 200 000   | 0.100% Caisse Francaise de Financement<br>Local 13/11/2029      | 163 354           | 0,03  | 50 000           | 1.250% Cyprus Government International<br>Bond 21/01/2040  | 32 202  | 0,01 |
| 200 000   | 0.010% Caisse Francaise de Financement<br>Local 24/06/2030      | 159 122           | 0,03  | 50 000           | 2.750% Cyprus Government International<br>Bond 03/05/2049  | 39 719  | 0,01 |
| 100 000   | 1.125% Caisse Francaise de Financement<br>Local 01/12/2031      | 84 223            | 0,02  | 25 000           | 2.250% Cyprus Government International<br>Bond 16/04/2050  | 18 034  | 0,00 |
| 100 000   | 1.450% Caisse Francaise de Financement<br>Local 16/01/2034      | 83 120            | 0,02  | 200 000          | 0.010% Development Bank of Japan Inc<br>09/09/2025         | 184 002 | 0,04 |
|   |   |                   |   | 100 000          | 1.500% Diageo Capital BV 08/06/2029                        | 89 464  | 0,02 |



## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 200 000 0.500% European Stability Mechanism 05/03/2029            | 173 734          | 0,04              |
| 200 000 1.875% European Union 04/04/2024                          | 197 498          | 0,04              |
| 100 000 0.250% Export Development Canada 07/03/2026               | 91 995           | 0,02              |
| 100 000 0.500% Export Development Canada 25/02/2027               | 90 720           | 0,02              |
| 235 000 2.000% Finland Government Bond 15/04/2024                 | 232 735          | 0,05              |
| 170 000 0.000% Finland Government Bond 15/09/2024                 | 163 127          | 0,03              |
| 230 000 4.000% Finland Government Bond 04/07/2025                 | 236 199          | 0,05              |
| 170 000 0.875% Finland Government Bond 15/09/2025                 | 162 651          | 0,03              |
| 250 000 0.500% Finland Government Bond 15/04/2026                 | 235 280          | 0,05              |
| 200 000 0.000% Finland Government Bond 15/09/2026                 | 182 732          | 0,04              |
| 120 000 1.375% Finland Government Bond 15/04/2027                 | 114 179          | 0,02              |
| 250 000 0.500% Finland Government Bond 15/09/2027                 | 228 038          | 0,05              |
| 230 000 2.750% Finland Government Bond 04/07/2028                 | 230 837          | 0,05              |
| 190 000 0.500% Finland Government Bond 15/09/2028                 | 169 026          | 0,04              |
| 260 000 0.500% Finland Government Bond 15/09/2029                 | 225 713          | 0,05              |
| 150 000 0.000% Finland Government Bond 15/09/2030                 | 122 225          | 0,03              |
| 180 000 0.750% Finland Government Bond 15/04/2031                 | 153 470          | 0,03              |
| 180 000 0.125% Finland Government Bond 15/09/2031                 | 143 865          | 0,03              |
| 250 000 1.500% Finland Government Bond 15/09/2032                 | 222 090          | 0,05              |
| 190 000 1.125% Finland Government Bond 15/04/2034                 | 157 518          | 0,03              |
| 180 000 0.125% Finland Government Bond 15/04/2036                 | 123 575          | 0,03              |
| 150 000 2.750% Finland Government Bond 15/04/2038                 | 143 241          | 0,03              |
| 220 000 0.250% Finland Government Bond 15/09/2040                 | 137 236          | 0,03              |
| 205 000 2.625% Finland Government Bond 04/07/2042                 | 193 645          | 0,04              |
| 120 000 0.500% Finland Government Bond 15/04/2043                 | 74 998           | 0,02              |
| 170 000 1.375% Finland Government Bond 15/04/2047                 | 126 415          | 0,03              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 190 000 0.125% Finland Government Bond 15/04/2052                 | 89 988           | 0,02              |
| 100 000 0.500% Finnvera Oyj 13/04/2026                            | 92 345           | 0,02              |
| 100 000 0.000% Free and Hanseatic City of Hamburg 07/04/2026      | 91 244           | 0,02              |
| 300 000 0.010% Free and Hanseatic City of Hamburg 03/06/2030      | 243 606          | 0,05              |
| 100 000 1.450% Free and Hanseatic City of Hamburg 05/11/2038      | 78 679           | 0,02              |
| 100 000 0.400% Free and Hanseatic City of Hamburg 23/11/2051      | 48 875           | 0,01              |
| 200 000 0.010% Free State of Bavaria 15/01/2026                   | 183 614          | 0,04              |
| 100 000 0.010% Free State of Bavaria 07/05/2027                   | 88 699           | 0,02              |
| 100 000 0.010% Free State of Saxony 06/08/2025                    | 92 980           | 0,02              |
| 100 000 0.010% Free State of Saxony 29/04/2031                    | 79 095           | 0,02              |
| 1 300 000 2.250% French Republic Government Bond OAT 25/05/2024   | 1 288 976        | 0,27              |
| 1 550 000 1.750% French Republic Government Bond OAT 25/11/2024   | 1 522 797        | 0,32              |
| 1 300 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/02/2025   | 1 233 284        | 0,26              |
| 1 850 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/03/2025   | 1 751 820        | 0,37              |
| 1 700 000 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2025   | 1 620 712        | 0,34              |
| 1 200 000 6.000% French Republic Government Bond OAT 25/10/2025   | 1 295 484        | 0,27              |
| 1 460 000 1.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2025   | 1 397 673        | 0,30              |
| 1 900 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/02/2026   | 1 759 875        | 0,37              |
| 1 680 000 3.500% French Republic Government Bond OAT 25/04/2026   | 1 720 018        | 0,36              |
| 1 950 000 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2026   | 1 823 893        | 0,39              |
| 500 000 2.500% French Republic Government Bond OAT 24/09/2026     | 496 706          | 0,11              |
| 1 450 000 0.250% French Republic Government Bond OAT 25/11/2026   | 1 330 795        | 0,28              |
| 1 650 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/02/2027   | 1 490 544        | 0,32              |
| 1 250 000 1.000% French Republic Government Bond OAT 25/05/2027   | 1 169 600        | 0,25              |
| 2 230 000 2.750% French Republic Government Bond OAT 25/10/2027   | 2 240 526        | 0,47              |
| 1 600 000 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/02/2028   | 1 460 896        | 0,31              |
| 2 200 000 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/05/2028   | 2 001 802        | 0,42              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 2 930 000 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/11/2028   | 2 642 684        | 0,56              |
| 565 000 5.500% French Republic Government Bond OAT 25/04/2029     | 653 151          | 0,14              |
| 2 750 000 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2029   | 2 418 652        | 0,51              |
| 2 000 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2029   | 1 680 720        | 0,36              |
| 2 220 000 2.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2030   | 2 199 065        | 0,47              |
| 2 650 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2030   | 2 164 016        | 0,46              |
| 2 375 000 1.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2031   | 2 174 764        | 0,46              |
| 2 050 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2031   | 1 623 939        | 0,34              |
| 1 620 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/05/2032   | 1 261 672        | 0,27              |
| 740 000 5.750% French Republic Government Bond OAT 25/10/2032     | 922 706          | 0,20              |
| 1 750 000 2.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2032   | 1 632 085        | 0,35              |
| 1 580 000 1.250% French Republic Government Bond OAT 25/05/2034   | 1 326 394        | 0,28              |
| 1 265 000 4.750% French Republic Government Bond OAT 25/04/2035   | 1 487 400        | 0,32              |
| 2 075 000 1.250% French Republic Government Bond OAT 25/05/2036   | 1 673 487        | 0,35              |
| 450 000 1.250% French Republic Government Bond OAT 25/05/2038     | 349 530          | 0,07              |
| 820 000 4.000% French Republic Government Bond OAT 25/10/2038     | 907 601          | 0,19              |
| 1 250 000 1.750% French Republic Government Bond OAT 25/06/2039   | 1 041 437        | 0,22              |
| 1 050 000 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2040   | 684 631          | 0,14              |
| 1 450 000 4.500% French Republic Government Bond OAT 25/04/2041   | 1 711 435        | 0,36              |
| 200 000 2.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2043     | 178 874          | 0,04              |
| 700 000 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/06/2044     | 417 921          | 0,09              |
| 1 180 000 3.250% French Republic Government Bond OAT 25/05/2045   | 1 190 349        | 0,25              |
| 1 140 000 2.000% French Republic Government Bond OAT 25/05/2048   | 907 144          | 0,19              |
| 1 270 000 1.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2050   | 886 306          | 0,19              |
| 1 290 000 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/05/2052   | 706 030          | 0,15              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 1 250 000 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/05/2053   | 665 221          | 0,14              |
| 200 000 3.000% French Republic Government Bond OAT 25/05/2054     | 189 876          | 0,04              |
| 765 000 4.000% French Republic Government Bond OAT 25/04/2055     | 878 434          | 0,19              |
| 670 000 4.000% French Republic Government Bond OAT 25/04/2060     | 778 855          | 0,16              |
| 665 000 1.750% French Republic Government Bond OAT 25/05/2066     | 456 531          | 0,10              |
| 410 000 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2072     | 162 413          | 0,03              |
| 50 000 1.750% Gemeinsame Deutsche Bundeslaender 14/05/2024        | 49 150           | 0,01              |
| 150 000 0.500% Gemeinsame Deutsche Bundeslaender 05/02/2025       | 142 865          | 0,03              |
| 200 000 0.375% Gemeinsame Deutsche Bundeslaender 17/04/2025       | 189 048          | 0,04              |
| 100 000 0.625% Gemeinsame Deutsche Bundeslaender 13/02/2029       | 87 667           | 0,02              |
| 100 000 1.250% Hungary Government International Bond 22/10/2025   | 93 003           | 0,02              |
| 100 000 1.125% Hungary Government International Bond 28/04/2026   | 91 179           | 0,02              |
| 100 000 0.125% Hungary Government International Bond 21/09/2028   | 76 768           | 0,02              |
| 200 000 4.250% Hungary Government International Bond 16/06/2031   | 182 462          | 0,04              |
| 100 000 0.000% Iceland Government International Bond 15/04/2028   | 83 213           | 0,02              |
| 200 000 3.050% Ile-de-France Mobilites 03/02/2033                 | 197 434          | 0,04              |
| 100 000 1.750% Indonesia Government International Bond 24/04/2025 | 95 805           | 0,02              |
| 200 000 3.750% Indonesia Government International Bond 14/06/2028 | 196 454          | 0,04              |
| 100 000 0.000% Instituto de Credito Oficial 30/04/2027            | 88 317           | 0,02              |
| 100 000 0.050% InvestitionsBank des Landes Brandenburg 29/09/2031 | 78 121           | 0,02              |
| 100 000 0.010% Investitionsbank Schleswig-Holstein 15/05/2026     | 90 788           | 0,02              |
| 410 000 5.400% Ireland Government Bond 13/03/2025                 | 431 496          | 0,09              |
| 525 000 1.000% Ireland Government Bond 15/05/2026                 | 499 984          | 0,11              |
| 320 000 0.200% Ireland Government Bond 15/05/2027                 | 290 042          | 0,06              |
| 330 000 0.900% Ireland Government Bond 15/05/2028                 | 302 844          | 0,06              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |                     |                         | <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |                     |                         | <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |                     |                         | <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |                     |                         |
| 360 000 1.100% Ireland Government Bond<br>15/05/2029              | 329 566             | 0,07                    | 850 000 5.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>01/03/2025    | 877 336             | 0,19                    |
| 340 000 2.400% Ireland Government Bond<br>15/05/2030              | 335 998             | 0,07                    | 300 000 3.400% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>28/03/2025    | 300 300             | 0,06                    |
| 250 000 0.200% Ireland Government Bond<br>18/10/2030              | 208 673             | 0,04                    | 550 000 1.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>15/05/2025    | 530 227             | 0,11                    |
| 280 000 1.350% Ireland Government Bond<br>18/03/2031              | 254 170             | 0,05                    | 970 000 1.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>01/06/2025    | 934 459             | 0,20                    |
| 370 000 0.000% Ireland Government Bond<br>18/10/2031              | 293 816             | 0,06                    | 600 000 1.850% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>01/07/2025    | 581 958             | 0,12                    |
| 180 000 0.350% Ireland Government Bond<br>18/10/2032              | 144 175             | 0,03                    | 600 000 1.200% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>15/08/2025    | 571 542             | 0,12                    |
| 230 000 1.300% Ireland Government Bond<br>15/05/2033              | 200 268             | 0,04                    | 950 000 2.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>15/11/2025    | 931 114             | 0,20                    |
| 170 000 0.400% Ireland Government Bond<br>15/05/2035              | 125 945             | 0,03                    | 500 000 2.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>01/12/2025    | 483 190             | 0,10                    |
| 265 000 1.700% Ireland Government Bond<br>15/05/2037              | 224 484             | 0,05                    | 600 000 3.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>15/01/2026    | 601 854             | 0,13                    |
| 200 000 0.550% Ireland Government Bond<br>22/04/2041              | 129 380             | 0,03                    | 700 000 0.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>01/02/2026    | 646 485             | 0,14                    |
| 140 000 3.000% Ireland Government Bond<br>18/10/2043              | 137 809             | 0,03                    | 885 000 4.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>01/03/2026    | 912 895             | 0,19                    |
| 365 000 2.000% Ireland Government Bond<br>18/02/2045              | 298 267             | 0,06                    | 750 000 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>01/04/2026    | 678 795             | 0,14                    |
| 330 000 1.500% Ireland Government Bond<br>15/05/2050              | 231 139             | 0,05                    | 200 000 3.800% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>15/04/2026    | 202 010             | 0,04                    |
| 150 000 1.500% Israel Government International<br>Bond 18/01/2027 | 137 205             | 0,03                    | 865 000 1.600% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>01/06/2026    | 819 769             | 0,17                    |
| 100 000 2.500% Israel Government International<br>Bond 16/01/2049 | 76 284              | 0,02                    | 800 000 2.100% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>15/07/2026    | 768 944             | 0,16                    |
| 700 000 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>15/04/2024    | 677 586             | 0,14                    | 700 000 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>01/08/2026    | 626 164             | 0,13                    |
| 600 000 1.850% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>15/05/2024    | 591 324             | 0,13                    | 520 000 7.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>01/11/2026    | 587 226             | 0,12                    |
| 700 000 1.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>30/05/2024    | 688 065             | 0,15                    | 900 000 1.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>01/12/2026    | 834 597             | 0,18                    |
| 450 000 1.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>01/07/2024    | 442 116             | 0,09                    | 900 000 0.850% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>15/01/2027    | 819 324             | 0,17                    |
| 600 000 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>15/08/2024    | 574 944             | 0,12                    | 1 250 000 1.100% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>01/04/2027  | 1 142 937           | 0,24                    |
| 905 000 3.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>01/09/2024    | 911 471             | 0,19                    | 650 000 2.200% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>01/06/2027    | 619 242             | 0,13                    |
| 500 000 1.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>15/11/2024    | 486 725             | 0,10                    | 870 000 2.050% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>01/08/2027    | 821 454             | 0,17                    |
| 960 000 2.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>01/12/2024    | 949 814             | 0,20                    | 800 000 0.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>15/09/2027    | 717 904             | 0,15                    |
| 600 000 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>15/12/2024    | 568 692             | 0,12                    | 430 000 6.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>01/11/2027    | 485 285             | 0,10                    |
| 700 000 0.350% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>01/02/2025    | 664 762             | 0,14                    | 800 000 2.650% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>01/12/2027    | 770 904             | 0,16                    |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 890 000 2.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/02/2028       | 830 931          | 0,18              |
| 800 000 0.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/03/2028       | 681 336          | 0,14              |
| 450 000 3.400% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/04/2028       | 446 080          | 0,09              |
| 400 000 0.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/07/2028       | 341 144          | 0,07              |
| 1 050 000 4.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2028     | 1 110 742        | 0,24              |
| 1 050 000 2.800% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2028     | 1 007 632        | 0,21              |
| 600 000 0.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/02/2029       | 499 530          | 0,11              |
| 1 400 000 2.800% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/06/2029     | 1 330 434        | 0,28              |
| 860 000 3.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2029       | 827 655          | 0,18              |
| 510 000 5.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/11/2029       | 557 165          | 0,12              |
| 900 000 3.850% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/12/2029       | 903 132          | 0,19              |
| 1 275 000 3.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2030     | 1 257 112        | 0,27              |
| 1 050 000 1.350% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/04/2030     | 894 537          | 0,19              |
| 950 000 0.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2030       | 777 613          | 0,16              |
| 1 000 000 1.650% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2030     | 856 250          | 0,18              |
| 1 250 000 0.900% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/04/2031     | 998 675          | 0,21              |
| 1 000 000 6.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/05/2031     | 1 150 170        | 0,24              |
| 800 000 0.600% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2031       | 614 984          | 0,13              |
| 950 000 0.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2031       | 745 398          | 0,16              |
| 830 000 1.650% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2032       | 690 494          | 0,15              |
| 850 000 0.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/06/2032       | 656 183          | 0,14              |
| 650 000 2.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2032       | 572 910          | 0,12              |
| 700 000 5.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/02/2033       | 794 619          | 0,17              |
| 500 000 4.400% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/05/2033       | 513 150          | 0,11              |
| 1 000 000 2.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2033     | 862 500          | 0,18              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 610 000 5.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2034       | 654 573          | 0,14              |
| 600 000 3.350% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2035       | 550 518          | 0,12              |
| 400 000 4.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 30/04/2035       | 391 184          | 0,08              |
| 650 000 1.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2036       | 475 702          | 0,10              |
| 550 000 2.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2036       | 441 870          | 0,09              |
| 1 095 000 4.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/02/2037     | 1 070 428        | 0,23              |
| 650 000 0.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2037       | 430 820          | 0,09              |
| 400 000 3.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2038       | 352 964          | 0,07              |
| 720 000 2.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2038       | 613 201          | 0,13              |
| 815 000 5.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2039       | 876 590          | 0,19              |
| 570 000 3.100% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2040       | 486 529          | 0,10              |
| 825 000 5.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2040       | 890 167          | 0,19              |
| 740 000 1.800% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2041       | 510 496          | 0,11              |
| 200 000 4.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2043       | 200 426          | 0,04              |
| 705 000 4.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2044       | 740 292          | 0,16              |
| 550 000 1.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 30/04/2045       | 333 185          | 0,07              |
| 645 000 3.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2046       | 544 470          | 0,12              |
| 780 000 2.700% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2047       | 596 232          | 0,13              |
| 740 000 3.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2048       | 641 055          | 0,14              |
| 550 000 3.850% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2049       | 505 417          | 0,11              |
| 595 000 2.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2050       | 418 029          | 0,09              |
| 620 000 1.700% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2051       | 364 975          | 0,08              |
| 320 000 2.150% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2052       | 206 333          | 0,04              |
| 220 000 4.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/10/2053       | 221 142          | 0,05              |
| 330 000 2.800% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2067       | 231 330          | 0,05              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR   | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets                                    |         |      |
|---|--|-------------------|---|------------------|--|---------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |                  |  |         |      |
| <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |  |                   | <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |                  |  |         |      |
| <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |  |                   | <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |                  |  |         |      |
| 210 000   | 2.150% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2072        | 122 627           | 0,03  | 660 000          | 4.250% Kingdom of Belgium Government Bond 28/03/2041 | 746 064 | 0,16 |
| 200 000   | 3.125% Japan Bank for International Cooperation 15/02/2028 | 198 736           | 0,04  | 385 000          | 3.750% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2045 | 411 280 | 0,09 |
| 495 000   | 2.600% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2024       | 493 362           | 0,10  | 400 000          | 1.600% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2047 | 287 284 | 0,06 |
| 520 000   | 0.500% Kingdom of Belgium Government Bond 22/10/2024       | 502 263           | 0,11  | 400 000          | 1.700% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2050 | 286 028 | 0,06 |
| 830 000   | 0.800% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2025       | 796 451           | 0,17  | 430 000          | 1.400% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2053 | 274 211 | 0,06 |
| 430 000   | 4.500% Kingdom of Belgium Government Bond 28/03/2026       | 452 347           | 0,10  | 160 000          | 3.300% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2054 | 157 210 | 0,03 |
| 650 000   | 1.000% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2026       | 617 071           | 0,13  | 280 000          | 2.250% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2057 | 220 324 | 0,05 |
| 900 000   | 0.800% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2027       | 834 102           | 0,18  | 320 000          | 2.150% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2066 | 242 218 | 0,05 |
| 290 000   | 0.000% Kingdom of Belgium Government Bond 22/10/2027       | 257 453           | 0,05  | 210 000          | 0.650% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2071 | 88 223  | 0,02 |
| 710 000   | 5.500% Kingdom of Belgium Government Bond 28/03/2028       | 804 196           | 0,17  | 100 000          | 0.050% Kommunalbanken AS 24/10/2029                  | 82 219  | 0,02 |
| 680 000   | 0.800% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2028       | 620 235           | 0,13  | 100 000          | 0.625% Kommunekredit 11/05/2026                      | 92 577  | 0,02 |
| 750 000   | 0.900% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2029       | 675 157           | 0,14  | 200 000          | 0.750% Kommunekredit 18/05/2027                      | 182 240 | 0,04 |
| 470 000   | 0.100% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2030       | 389 489           | 0,08  | 100 000          | 0.875% Kommunekredit 03/11/2036                      | 74 454  | 0,02 |
| 650 000   | 1.000% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2031       | 564 135           | 0,12  | 100 000          | 0.625% Kommunekredit 21/11/2039                      | 67 485  | 0,01 |
| 500 000   | 0.000% Kingdom of Belgium Government Bond 22/10/2031       | 392 785           | 0,08  | 100 000          | 0.010% Korea Housing Finance Corp 05/02/2025         | 93 356  | 0,02 |
| 240 000   | 4.000% Kingdom of Belgium Government Bond 28/03/2032       | 261 002           | 0,06  | 100 000          | 0.010% Korea Housing Finance Corp 07/07/2025         | 91 865  | 0,02 |
| 730 000   | 0.350% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2032       | 580 978           | 0,12  | 100 000          | 0.000% Kuntarahoitus Oyj 22/04/2025                  | 93 625  | 0,02 |
| 390 000   | 1.250% Kingdom of Belgium Government Bond 22/04/2033       | 334 983           | 0,07  | 100 000          | 0.750% Kuntarahoitus Oyj 07/09/2027                  | 90 707  | 0,02 |
| 700 000   | 3.000% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2033       | 702 009           | 0,15  | 100 000          | 0.050% Kuntarahoitus Oyj 06/09/2029                  | 83 109  | 0,02 |
| 660 000   | 3.000% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2034       | 656 324           | 0,14  | 200 000          | 0.000% Kuntarahoitus Oyj 14/10/2030                  | 160 406 | 0,03 |
| 450 000   | 5.000% Kingdom of Belgium Government Bond 28/03/2035       | 534 865           | 0,11  | 200 000          | 0.010% Land Baden-Wuerttemberg 04/08/2027            | 176 034 | 0,04 |
| 300 000   | 1.450% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2037       | 241 479           | 0,05  | 200 000          | 0.800% Land Baden-Wuerttemberg 05/04/2028            | 180 120 | 0,04 |
| 320 000   | 1.900% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2038       | 270 109           | 0,06  | 100 000          | 0.010% Land Baden-Wuerttemberg 07/03/2031            | 79 416  | 0,02 |
| 150 000   | 2.750% Kingdom of Belgium Government Bond 22/04/2039       | 140 939           | 0,03  | 100 000          | 1.625% Land Berlin 03/06/2024                        | 98 123  | 0,02 |
| 370 000   | 0.400% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2040       | 232 071           | 0,05  | 100 000          | 0.010% Land Berlin 18/05/2027                        | 88 592  | 0,02 |
|   |  |                   |   | 100 000          | 0.010% Land Berlin 26/10/2028                        | 85 195  | 0,02 |
|   |  |                   |   | 100 000          | 0.625% Land Berlin 05/02/2029                        | 87 686  | 0,02 |
|   |  |                   |   | 100 000          | 0.125% Land Berlin 20/10/2031                        | 78 784  | 0,02 |
|   |  |                   |   | 50 000           | 1.000% Land Berlin 19/05/2032                        | 42 218  | 0,01 |
|   |  |                   |   | 100 000          | 1.625% Land Berlin 02/08/2032                        | 89 155  | 0,02 |
|   |  |                   |   | 100 000          | 1.300% Land Berlin 13/06/2033                        | 85 218  | 0,02 |
|   |  |                   |   | 300 000          | 0.125% Land Berlin 04/06/2035                        | 210 069 | 0,04 |
|   |  |                   |   | 100 000          | 0.625% Land Berlin 25/08/2036                        | 72 512  | 0,02 |
|   |  |                   |   | 100 000          | 0.050% Land Berlin 06/08/2040                        | 58 139  | 0,01 |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |                  |                   | <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 100 000 0.125% Land Berlin 24/11/2045                             | 51 181           | 0,01              | 100 000 0.050% Nederlandse Waterschapsbank NV 28/01/2030          | 82 035           | 0,02              |
| 50 000 0.200% Land Thuringen 26/10/2026                           | 45 271           | 0,01              | 100 000 0.000% Nederlandse Waterschapsbank NV 16/02/2037          | 64 578           | 0,01              |
| 100 000 0.500% Land Thuringen 02/03/2027                          | 90 821           | 0,02              | 100 000 1.500% Nederlandse Waterschapsbank NV 27/04/2038          | 79 721           | 0,02              |
| 100 000 0.010% Land Thuringen 24/03/2031                          | 79 423           | 0,02              | 200 000 0.750% Nederlandse Waterschapsbank NV 04/10/2041          | 130 120          | 0,03              |
| 200 000 0.375% Latvia Government International Bond 07/10/2026    | 179 150          | 0,04              | 100 000 0.500% Nederlandse Waterschapsbank NV 26/04/2051          | 50 510           | 0,01              |
| 150 000 0.000% Latvia Government International Bond 17/03/2031    | 111 024          | 0,02              | 590 000 2.000% Netherlands Government Bond 15/07/2024             | 584 383          | 0,12              |
| 100 000 1.875% Latvia Government International Bond 19/02/2049    | 70 479           | 0,01              | 830 000 0.250% Netherlands Government Bond 15/07/2025             | 786 525          | 0,17              |
| 250 000 0.950% Lithuania Government International Bond 26/05/2027 | 225 408          | 0,05              | 260 000 0.000% Netherlands Government Bond 15/01/2026             | 241 930          | 0,05              |
| 50 000 2.100% Lithuania Government International Bond 26/05/2047  | 37 656           | 0,01              | 770 000 0.500% Netherlands Government Bond 15/07/2026             | 720 397          | 0,15              |
| 200 000 0.500% Lithuania Government International Bond 28/07/2050 | 89 230           | 0,02              | 650 000 0.000% Netherlands Government Bond 15/01/2027             | 591 058          | 0,13              |
| 100 000 0.000% Luxembourg Government Bond 28/04/2025              | 93 774           | 0,02              | 680 000 0.750% Netherlands Government Bond 15/07/2027             | 631 020          | 0,13              |
| 100 000 0.000% Luxembourg Government Bond 13/11/2026              | 89 945           | 0,02              | 530 000 5.500% Netherlands Government Bond 15/01/2028             | 599 218          | 0,13              |
| 70 000 0.625% Luxembourg Government Bond 01/02/2027               | 64 063           | 0,01              | 500 000 0.750% Netherlands Government Bond 15/07/2028             | 456 570          | 0,10              |
| 100 000 1.625% Mexico Government International Bond 08/04/2026    | 93 926           | 0,02              | 480 000 0.000% Netherlands Government Bond 15/01/2029             | 415 051          | 0,09              |
| 200 000 1.750% Mexico Government International Bond 17/04/2028    | 178 608          | 0,04              | 500 000 0.250% Netherlands Government Bond 15/07/2029             | 434 335          | 0,09              |
| 100 000 3.375% Mexico Government International Bond 23/02/2031    | 92 188           | 0,02              | 576 000 0.000% Netherlands Government Bond 15/07/2030             | 479 272          | 0,10              |
| 100 000 1.450% Mexico Government International Bond 25/10/2033    | 72 178           | 0,02              | 450 000 0.000% Netherlands Government Bond 15/07/2031             | 364 950          | 0,08              |
| 100 000 4.000% Mexico Government International Bond 12/12/2049    | 70 767           | 0,01              | 550 000 0.500% Netherlands Government Bond 15/07/2032             | 456 274          | 0,10              |
| 100 000 2.125% Mexico Government International Bond 25/10/2051    | 56 032           | 0,01              | 585 000 2.500% Netherlands Government Bond 15/01/2033             | 579 390          | 0,12              |
| 200 000 0.010% Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 23/06/2027  | 176 836          | 0,04              | 600 000 2.500% Netherlands Government Bond 15/07/2033             | 592 102          | 0,13              |
| 100 000 1.375% Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 21/11/2033  | 83 151           | 0,02              | 715 000 4.000% Netherlands Government Bond 15/01/2037             | 817 474          | 0,17              |
| 200 000 0.125% Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 15/10/2035  | 134 048          | 0,03              | 480 000 0.000% Netherlands Government Bond 15/01/2038             | 321 091          | 0,07              |
| 100 000 1.875% Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 02/06/2042  | 77 069           | 0,02              | 570 000 0.500% Netherlands Government Bond 15/01/2040             | 400 676          | 0,08              |
| 100 000 1.500% Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 11/04/2044  | 69 718           | 0,01              | 700 000 3.750% Netherlands Government Bond 15/01/2042             | 802 690          | 0,17              |
| 200 000 0.250% Nederlandse Waterschapsbank NV 07/06/2024          | 192 760          | 0,04              | 760 000 2.750% Netherlands Government Bond 15/01/2047             | 774 417          | 0,16              |
| 100 000 0.625% Nederlandse Waterschapsbank NV 18/01/2027          | 91 457           | 0,02              |   |                  |                   |
| 300 000 0.625% Nederlandse Waterschapsbank NV 06/02/2029          | 261 588          | 0,06              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                       | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>  |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b>  |                  |                   | <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                      |                  |                   | <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 520 000 0.000% Netherlands Government Bond 15/01/2052              | 255 523          | 0,05              | 230 000 1.000% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 12/04/2052       | 122 467          | 0,03              |
| 270 000 2.000% Netherlands Government Bond 15/01/2054              | 236 185          | 0,05              | 100 000 0.625% Province of Alberta Canada 16/01/2026              | 93 269           | 0,02              |
| 100 000 0.250% Niedersachsen Invest GmbH 16/07/2035                | 71 264           | 0,01              | 100 000 1.875% Province of Ontario Canada 21/05/2024              | 98 169           | 0,02              |
| 100 000 0.900% Ontario Teachers' Finance Trust 20/05/2041          | 64 786           | 0,01              | 100 000 0.625% Province of Ontario Canada 17/04/2025              | 94 630           | 0,02              |
| 100 000 0.950% Ontario Teachers' Finance Trust 24/11/2051          | 53 606           | 0,01              | 100 000 0.375% Province of Ontario Canada 08/04/2027              | 89 367           | 0,02              |
| 100 000 3.750% Peruvian Government International Bond 01/03/2030   | 95 228           | 0,02              | 100 000 0.010% Province of Ontario Canada 25/11/2030              | 78 248           | 0,02              |
| 100 000 1.250% Peruvian Government International Bond 11/03/2033   | 72 242           | 0,02              | 100 000 0.250% Province of Ontario Canada 09/06/2031              | 78 341           | 0,02              |
| 100 000 0.700% Philippine Government International Bond 03/02/2029 | 82 097           | 0,02              | 100 000 0.875% Province of Quebec Canada 15/01/2025               | 95 687           | 0,02              |
| 100 000 1.750% Philippine Government International Bond 28/04/2041 | 63 203           | 0,01              | 200 000 0.875% Province of Quebec Canada 04/05/2027               | 182 088          | 0,04              |
| 570 000 2.875% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 15/10/2025        | 572 508          | 0,12              | 200 000 0.000% Province of Quebec Canada 15/10/2029               | 162 332          | 0,03              |
| 440 000 2.875% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 21/07/2026        | 442 820          | 0,09              | 200 000 3.000% Province of Quebec Canada 24/01/2033               | 193 896          | 0,04              |
| 400 000 4.125% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 14/04/2027        | 421 528          | 0,09              | 100 000 1.750% Regie Autonome des Transports Parisiens 25/05/2031 | 90 551           | 0,02              |
| 280 000 0.700% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 15/10/2027        | 256 777          | 0,05              | 100 000 0.500% Region of Ile de France 14/06/2025                 | 94 361           | 0,02              |
| 610 000 2.125% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 17/10/2028        | 591 169          | 0,13              | 100 000 0.000% Region of Ile de France 20/04/2028                 | 85 823           | 0,02              |
| 370 000 1.950% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 15/06/2029        | 352 592          | 0,07              | 100 000 0.250% Region Wallonne Belgium 03/05/2026                 | 91 734           | 0,02              |
| 320 000 3.875% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 15/02/2030        | 339 651          | 0,07              | 100 000 3.250% Region Wallonne Belgium 22/06/2033                 | 98 857           | 0,02              |
| 500 000 0.475% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 18/10/2030        | 417 190          | 0,09              | 100 000 0.500% Region Wallonne Belgium 22/06/2037                 | 66 364           | 0,01              |
| 300 000 0.300% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 17/10/2031        | 239 178          | 0,05              | 100 000 3.500% Region Wallonne Belgium 15/03/2043                 | 97 094           | 0,02              |
| 200 000 1.650% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 16/07/2032        | 176 524          | 0,04              | 100 000 1.250% Region Wallonne Belgium 22/06/2071                 | 50 453           | 0,01              |
| 280 000 2.250% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 18/04/2034        | 255 102          | 0,05              | 450 000 0.000% Republic of Austria Government Bond 15/07/2024     | 434 524          | 0,09              |
| 300 000 0.900% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 12/10/2035        | 226 815          | 0,05              | 370 000 1.650% Republic of Austria Government Bond 21/10/2024     | 363 462          | 0,08              |
| 400 000 4.100% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 15/04/2037        | 431 120          | 0,09              | 400 000 0.000% Republic of Austria Government Bond 20/04/2025     | 378 096          | 0,08              |
| 120 000 3.500% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 18/06/2038        | 120 701          | 0,03              | 500 000 1.200% Republic of Austria Government Bond 20/10/2025     | 481 660          | 0,10              |
| 200 000 1.150% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 11/04/2042        | 134 231          | 0,03              | 280 000 4.850% Republic of Austria Government Bond 15/03/2026     | 297 046          | 0,06              |
| 155 000 4.100% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 15/02/2045        | 166 982          | 0,04              | 250 000 2.000% Republic of Austria Government Bond 15/07/2026     | 244 388          | 0,05              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>          |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b>          |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b>          |                  |                   | <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b>          |                  |                   |
| <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>  |                  |                   | <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 615 000 0.750% Republic of Austria Government Bond 20/10/2026              | 576 347          | 0,12              | 100 000 0.000% Republic of Poland Government International Bond 10/02/2025 | 93 343           | 0,02              |
| 705 000 0.500% Republic of Austria Government Bond 20/04/2027              | 646 351          | 0,14              | 100 000 1.125% Republic of Poland Government International Bond 07/08/2026 | 91 932           | 0,02              |
| 200 000 6.250% Republic of Austria Government Bond 15/07/2027              | 228 136          | 0,05              | 100 000 1.000% Republic of Poland Government International Bond 07/03/2029 | 85 190           | 0,02              |
| 450 000 0.750% Republic of Austria Government Bond 20/02/2028              | 410 319          | 0,09              | 100 000 3.875% Republic of Poland Government International Bond 14/02/2033 | 98 181           | 0,02              |
| 200 000 0.000% Republic of Austria Government Bond 20/10/2028              | 172 208          | 0,04              | 100 000 2.375% Republic of Poland Government International Bond 18/01/2036 | 82 396           | 0,02              |
| 530 000 0.500% Republic of Austria Government Bond 20/02/2029              | 465 303          | 0,10              | 100 000 4.250% Republic of Poland Government International Bond 14/02/2043 | 97 175           | 0,02              |
| 480 000 0.000% Republic of Austria Government Bond 20/02/2030              | 395 818          | 0,08              | 100 000 2.000% Republic of Poland Government International Bond 08/03/2049 | 67 959           | 0,01              |
| 450 000 0.000% Republic of Austria Government Bond 20/02/2031              | 360 189          | 0,08              | 200 000 0.700% Romania Government Bond 24/08/2026                          | 173 680          | 0,04              |
| 450 000 0.900% Republic of Austria Government Bond 20/02/2032              | 380 214          | 0,08              | 190 000 2.750% Romanian Government International Bond 29/10/2025           | 183 810          | 0,04              |
| 550 000 2.900% Republic of Austria Government Bond 20/02/2033              | 548 168          | 0,12              | 200 000 2.750% Romanian Government International Bond 26/02/2026           | 188 400          | 0,04              |
| 350 000 2.400% Republic of Austria Government Bond 23/05/2034              | 331 100          | 0,07              | 150 000 2.875% Romanian Government International Bond 26/05/2028           | 131 826          | 0,03              |
| 250 000 0.250% Republic of Austria Government Bond 20/10/2036              | 172 863          | 0,04              | 100 000 2.875% Romanian Government International Bond 11/03/2029           | 85 254           | 0,02              |
| 575 000 4.150% Republic of Austria Government Bond 15/03/2037              | 643 776          | 0,14              | 200 000 1.375% Romanian Government International Bond 02/12/2029           | 149 964          | 0,03              |
| 220 000 0.000% Republic of Austria Government Bond 20/10/2040              | 128 964          | 0,03              | 200 000 3.500% Romanian Government International Bond 03/04/2034           | 151 584          | 0,03              |
| 305 000 3.150% Republic of Austria Government Bond 20/06/2044              | 312 430          | 0,07              | 120 000 3.875% Romanian Government International Bond 29/10/2035           | 91 435           | 0,02              |
| 300 000 1.500% Republic of Austria Government Bond 20/02/2047              | 223 299          | 0,05              | 100 000 2.625% Romanian Government International Bond 02/12/2040           | 57 743           | 0,01              |
| 150 000 1.850% Republic of Austria Government Bond 23/05/2049              | 118 152          | 0,02              | 200 000 4.625% Romanian Government International Bond 03/04/2049           | 148 534          | 0,03              |
| 230 000 2.100% Republic of Austria Government Bond 12/12/2049              | 171 424          | 0,04              | 100 000 3.375% Romanian Government International Bond 28/01/2050           | 60 225           | 0,01              |
| 350 000 0.750% Republic of Austria Government Bond 20/03/2051              | 203 151          | 0,04              | 100 000 0.625% Saudi Government International Bond 03/03/2030              | 80 556           | 0,02              |
| 165 000 3.800% Republic of Austria Government Bond 26/01/2062              | 193 713          | 0,04              | 100 000 2.000% Saudi Government International Bond 09/07/2039              | 72 135           | 0,02              |
| 105 000 0.700% Republic of Austria Government Bond 20/04/2071              | 48 200           | 0,01              | 100 000 0.750% SFIL SA 06/02/2026  | 93 652           | 0,02              |
| 113 000 1.500% Republic of Austria Government Bond 02/11/2086              | 68 755           | 0,01              | 200 000 0.050% SFIL SA 04/06/2029  | 166 346          | 0,03              |
| 180 000 0.850% Republic of Austria Government Bond 30/06/2120              | 77 299           | 0,02              | 100 000 0.000% Slovakia Government Bond 17/06/2024                         | 96 456           | 0,02              |
| 50 000 5.125% Republic of Italy Government International Bond 31/07/2024   | 50 990           | 0,01              | 150 000 3.375% Slovakia Government Bond 15/11/2024                         | 150 446          | 0,03              |
| 200 000 5.250% Republic of Poland Government International Bond 20/01/2025 | 205 174          | 0,04              | 200 000 0.250% Slovakia Government Bond 14/05/2025                         | 188 106          | 0,04              |
|  |                  |                   | 100 000 0.625% Slovakia Government Bond 22/05/2026                         | 92 765           | 0,02              |



## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |                  |                   | <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 80 000 1.375% Slovakia Government Bond 21/01/2027                 | 75 139           | 0,02              | 40 000 1.175% Slovenia Government Bond 13/02/2062                 | 22 958           | 0,00              |
| 200 000 1.000% Slovakia Government Bond 12/06/2028                | 178 878          | 0,04              | 100 000 2.625% SNCF Reseau 29/12/2025                             | 98 816           | 0,02              |
| 40 000 3.625% Slovakia Government Bond 16/01/2029                 | 40 972           | 0,01              | 100 000 4.250% SNCF Reseau 07/10/2026                             | 103 821          | 0,02              |
| 150 000 0.750% Slovakia Government Bond 09/04/2030                | 125 955          | 0,03              | 200 000 1.125% SNCF Reseau 19/05/2027                             | 185 130          | 0,04              |
| 100 000 1.000% Slovakia Government Bond 09/10/2030                | 84 166           | 0,02              | 200 000 3.125% SNCF Reseau 25/10/2028                             | 200 394          | 0,04              |
| 150 000 1.625% Slovakia Government Bond 21/01/2031                | 132 225          | 0,03              | 100 000 1.000% SNCF Reseau 09/11/2031                             | 84 081           | 0,02              |
| 100 000 1.000% Slovakia Government Bond 14/05/2032                | 80 349           | 0,02              | 100 000 1.875% SNCF Reseau 30/03/2034                             | 86 584           | 0,02              |
| 100 000 3.875% Slovakia Government Bond 08/02/2033                | 102 289          | 0,02              | 100 000 2.000% SNCF Reseau 05/02/2048                             | 72 029           | 0,01              |
| 200 000 3.750% Slovakia Government Bond 23/02/2035                | 197 284          | 0,04              | 200 000 0.300% Societe Du Grand Paris EPIC 25/11/2031             | 156 690          | 0,03              |
| 100 000 0.375% Slovakia Government Bond 21/04/2036                | 64 298           | 0,01              | 200 000 1.125% Societe Du Grand Paris EPIC 25/05/2034             | 158 278          | 0,03              |
| 90 000 1.875% Slovakia Government Bond 09/03/2037                 | 71 328           | 0,01              | 100 000 1.700% Societe Du Grand Paris EPIC 25/05/2050             | 67 077           | 0,01              |
| 150 000 2.000% Slovakia Government Bond 17/10/2047                | 107 555          | 0,02              | 100 000 1.000% Societe Du Grand Paris EPIC 26/11/2051             | 52 684           | 0,01              |
| 50 000 1.000% Slovakia Government Bond 13/10/2051                 | 26 028           | 0,01              | 100 000 0.700% Societe Du Grand Paris EPIC 15/10/2060             | 39 139           | 0,01              |
| 160 000 2.125% Slovenia Government Bond 28/07/2025                | 159 125          | 0,03              | 200 000 1.000% Societe Du Grand Paris EPIC 18/02/2070             | 82 472           | 0,02              |
| 103 000 5.125% Slovenia Government Bond 30/03/2026                | 110 275          | 0,02              | 150 000 4.125% Societe Nationale SNCF SA 19/02/2025               | 152 204          | 0,03              |
| 150 000 1.000% Slovenia Government Bond 06/03/2028                | 135 876          | 0,03              | 100 000 3.125% Societe Nationale SNCF SA 02/11/2027               | 99 393           | 0,02              |
| 100 000 1.188% Slovenia Government Bond 14/03/2029                | 89 924           | 0,02              | 100 000 1.000% Societe Nationale SNCF SA 25/05/2040               | 65 622           | 0,01              |
| 200 000 0.875% Slovenia Government Bond 15/07/2030                | 169 534          | 0,04              | 100 000 0.875% Societe Nationale SNCF SA 28/02/2051               | 48 812           | 0,01              |
| 80 000 0.000% Slovenia Government Bond 12/02/2031                 | 62 190           | 0,01              | 735 000 3.800% Spain Government Bond 30/04/2024                   | 741 674          | 0,16              |
| 50 000 0.125% Slovenia Government Bond 01/07/2031                 | 39 091           | 0,01              | 700 000 0.000% Spain Government Bond 31/05/2024                   | 676 956          | 0,14              |
| 50 000 2.250% Slovenia Government Bond 03/03/2032                 | 46 075           | 0,01              | 650 000 0.250% Spain Government Bond 30/07/2024                   | 627 887          | 0,13              |
| 100 000 1.500% Slovenia Government Bond 25/03/2035                | 80 393           | 0,02              | 930 000 2.750% Spain Government Bond 31/10/2024                   | 927 796          | 0,20              |
| 170 000 1.750% Slovenia Government Bond 03/11/2040                | 129 394          | 0,03              | 1 300 000 0.000% Spain Government Bond 31/01/2025                 | 1 235 104        | 0,26              |
| 150 000 3.125% Slovenia Government Bond 07/08/2045                | 139 349          | 0,03              | 790 000 1.600% Spain Government Bond 30/04/2025                   | 770 384          | 0,16              |
| 100 000 0.488% Slovenia Government Bond 20/10/2050                | 48 839           | 0,01              | 850 000 0.000% Spain Government Bond 31/05/2025                   | 798 872          | 0,17              |
|   |                  |                   | 900 000 4.650% Spain Government Bond 30/07/2025                   | 936 252          | 0,20              |
|   |                  |                   | 980 000 2.150% Spain Government Bond 31/10/2025                   | 964 996          | 0,20              |
|   |                  |                   | 900 000 0.000% Spain Government Bond 31/01/2026                   | 830 637          | 0,18              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |                  |                   | <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 880 000 1.950% Spain Government Bond 30/04/2026                   | 856 926          | 0,18              | 780 000 2.350% Spain Government Bond 30/07/2033                   | 715 096          | 0,15              |
| 300 000 2.800% Spain Government Bond 31/05/2026                   | 298 974          | 0,06              | 850 000 1.850% Spain Government Bond 30/07/2035                   | 715 224          | 0,15              |
| 700 000 5.900% Spain Government Bond 30/07/2026                   | 766 206          | 0,16              | 940 000 4.200% Spain Government Bond 31/01/2037                   | 1 006 458        | 0,21              |
| 1 180 000 1.300% Spain Government Bond 31/10/2026                 | 1 119 018        | 0,24              | 700 000 0.850% Spain Government Bond 30/07/2037                   | 488 110          | 0,10              |
| 700 000 0.000% Spain Government Bond 31/01/2027                   | 627 452          | 0,13              | 250 000 3.900% Spain Government Bond 30/07/2039                   | 256 743          | 0,05              |
| 980 000 1.500% Spain Government Bond 30/04/2027                   | 928 325          | 0,20              | 780 000 4.900% Spain Government Bond 30/07/2040                   | 903 708          | 0,19              |
| 1 030 000 0.800% Spain Government Bond 30/07/2027                 | 943 099          | 0,20              | 640 000 1.200% Spain Government Bond 31/10/2040                   | 436 589          | 0,09              |
| 730 000 1.450% Spain Government Bond 31/10/2027                   | 684 711          | 0,14              | 850 000 4.700% Spain Government Bond 30/07/2041                   | 963 458          | 0,20              |
| 1 200 000 0.000% Spain Government Bond 31/01/2028                 | 1 042 836        | 0,22              | 300 000 1.000% Spain Government Bond 30/07/2042                   | 190 176          | 0,04              |
| 800 000 1.400% Spain Government Bond 30/04/2028                   | 742 288          | 0,16              | 250 000 3.450% Spain Government Bond 30/07/2043                   | 238 925          | 0,05              |
| 850 000 1.400% Spain Government Bond 30/07/2028                   | 785 986          | 0,17              | 665 000 5.150% Spain Government Bond 31/10/2044                   | 805 695          | 0,17              |
| 745 000 5.150% Spain Government Bond 31/10/2028                   | 826 540          | 0,17              | 805 000 2.900% Spain Government Bond 31/10/2046                   | 705 116          | 0,15              |
| 1 000 000 6.000% Spain Government Bond 31/01/2029                 | 1 160 500        | 0,25              | 605 000 2.700% Spain Government Bond 31/10/2048                   | 502 797          | 0,11              |
| 940 000 1.450% Spain Government Bond 30/04/2029                   | 861 059          | 0,18              | 800 000 1.000% Spain Government Bond 31/10/2050                   | 429 568          | 0,09              |
| 650 000 0.800% Spain Government Bond 30/07/2029                   | 567 313          | 0,12              | 450 000 1.900% Spain Government Bond 31/10/2052                   | 298 744          | 0,06              |
| 750 000 0.600% Spain Government Bond 31/10/2029                   | 643 710          | 0,14              | 575 000 3.450% Spain Government Bond 30/07/2066                   | 529 213          | 0,11              |
| 950 000 0.500% Spain Government Bond 30/04/2030                   | 798 532          | 0,17              | 250 000 1.450% Spain Government Bond 31/10/2071                   | 121 935          | 0,03              |
| 970 000 1.950% Spain Government Bond 30/07/2030                   | 900 267          | 0,19              | 50 000 1.625% State of Brandenburg 28/05/2024                     | 49 063           | 0,01              |
| 1 360 000 1.250% Spain Government Bond 31/10/2030                 | 1 193 903        | 0,25              | 100 000 0.625% State of Brandenburg 27/01/2025                    | 95 484           | 0,02              |
| 1 050 000 0.100% Spain Government Bond 30/04/2031                 | 826 959          | 0,18              | 200 000 0.500% State of Brandenburg 21/11/2039                    | 130 856          | 0,03              |
| 800 000 0.500% Spain Government Bond 31/10/2031                   | 642 184          | 0,14              | 100 000 0.050% State of Brandenburg 10/08/2040                    | 58 174           | 0,01              |
| 970 000 0.700% Spain Government Bond 30/04/2032                   | 781 054          | 0,17              | 100 000 0.150% State of Bremen 24/10/2031                         | 78 964           | 0,02              |
| 535 000 5.750% Spain Government Bond 30/07/2032                   | 644 627          | 0,14              | 100 000 1.500% State of Bremen 12/11/2038                         | 78 926           | 0,02              |
| 900 000 2.550% Spain Government Bond 31/10/2032                   | 848 421          | 0,18              | 100 000 1.000% State of Bremen 27/05/2039                         | 72 095           | 0,02              |
| 450 000 3.150% Spain Government Bond 30/04/2033                   | 443 610          | 0,09              | 100 000 0.150% State of Bremen 14/09/2040                         | 59 123           | 0,01              |
|   |                  |                   | 100 000 0.000% State of Hesse 26/07/2024                          | 95 858           | 0,02              |
|   |                  |                   | 50 000 0.875% State of Hesse 10/12/2024                           | 48 101           | 0,01              |
|   |                  |                   | 200 000 0.000% State of Hesse 10/03/2025                          | 188 188          | 0,04              |
|   |                  |                   | 40 000 0.000% State of Hesse 25/04/2025                           | 37 464           | 0,01              |
|   |                  |                   | 200 000 0.375% State of Hesse 06/07/2026                          | 183 602          | 0,04              |
|   |                  |                   | 195 000 0.000% State of Hesse 10/09/2026                          | 175 847          | 0,04              |
|   |                  |                   | 200 000 2.875% State of Hesse 10/01/2033                          | 198 938          | 0,04              |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |                  |                   | <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 100 000 1.300% State of Hesse 10/10/2033                          | 84 805           | 0,02              | 100 000 1.450% State of North Rhine-Westphalia Germany 16/02/2043 | 73 925           | 0,02              |
| 200 000 0.000% State of Lower Saxony 02/08/2024                   | 191 636          | 0,04              | 50 000 1.000% State of North Rhine-Westphalia Germany 16/10/2046  | 32 342           | 0,01              |
| 100 000 0.625% State of Lower Saxony 20/01/2025                   | 95 541           | 0,02              | 100 000 1.650% State of North Rhine-Westphalia Germany 16/05/2047 | 74 822           | 0,02              |
| 200 000 0.125% State of Lower Saxony 07/03/2025                   | 188 798          | 0,04              | 100 000 1.550% State of North Rhine-Westphalia Germany 16/06/2048 | 72 728           | 0,02              |
| 100 000 0.375% State of Lower Saxony 09/01/2026                   | 92 848           | 0,02              | 100 000 0.800% State of North Rhine-Westphalia Germany 30/07/2049 | 58 377           | 0,01              |
| 100 000 0.500% State of Lower Saxony 08/06/2026                   | 92 334           | 0,02              | 100 000 0.375% State of North Rhine-Westphalia Germany 02/09/2050 | 49 681           | 0,01              |
| 200 000 0.625% State of Lower Saxony 06/07/2027                   | 181 286          | 0,04              | 100 000 2.250% State of North Rhine-Westphalia Germany 14/06/2052 | 84 069           | 0,02              |
| 200 000 0.010% State of Lower Saxony 19/02/2029                   | 168 608          | 0,04              | 100 000 2.900% State of North Rhine-Westphalia Germany 15/01/2053 | 96 634           | 0,02              |
| 100 000 0.010% State of Lower Saxony 13/08/2030                   | 80 818           | 0,02              | 200 000 1.750% State of North Rhine-Westphalia Germany 26/10/2057 | 141 946          | 0,03              |
| 200 000 0.010% State of Lower Saxony 10/01/2031                   | 159 596          | 0,03              | 100 000 1.750% State of North Rhine-Westphalia Germany 11/07/2068 | 65 289           | 0,01              |
| 100 000 1.125% State of Lower Saxony 12/09/2033                   | 83 415           | 0,02              | 100 000 1.950% State of North Rhine-Westphalia Germany 26/09/2078 | 69 944           | 0,01              |
| 100 000 0.050% State of Lower Saxony 09/03/2035                   | 69 918           | 0,01              | 100 000 2.150% State of North Rhine-Westphalia Germany 21/03/2119 | 70 525           | 0,01              |
| 100 000 0.750% State of North Rhine-Westphalia Germany 16/01/2026 | 93 821           | 0,02              | 100 000 1.375% State of North Rhine-Westphalia Germany 15/01/2120 | 49 765           | 0,01              |
| 300 000 0.250% State of North Rhine-Westphalia Germany 13/03/2026 | 276 489          | 0,06              | 100 000 0.950% State of North Rhine-Westphalia Germany 10/01/2121 | 39 752           | 0,01              |
| 200 000 0.500% State of North Rhine-Westphalia Germany 16/04/2026 | 185 362          | 0,04              | 100 000 0.010% State of Rhineland-Palatinate 29/05/2024           | 96 354           | 0,02              |
| 100 000 0.200% State of North Rhine-Westphalia Germany 31/03/2027 | 89 533           | 0,02              | 100 000 0.500% State of Rhineland-Palatinate 21/01/2025           | 95 319           | 0,02              |
| 200 000 0.950% State of North Rhine-Westphalia Germany 13/03/2028 | 181 786          | 0,04              | 100 000 0.100% State of Rhineland-Palatinate 18/08/2026           | 90 654           | 0,02              |
| 100 000 0.200% State of North Rhine-Westphalia Germany 09/04/2030 | 82 851           | 0,02              | 100 000 0.375% State of Rhineland-Palatinate 26/01/2027           | 90 579           | 0,02              |
| 200 000 0.125% State of North Rhine-Westphalia Germany 04/06/2031 | 159 414          | 0,03              | 200 000 0.700% State of Rhineland-Palatinate 26/01/2028           | 179 842          | 0,04              |
| 200 000 2.375% State of North Rhine-Westphalia Germany 13/05/2033 | 189 390          | 0,04              | 100 000 0.010% State of Saxony-Anhalt 09/11/2026                  | 89 838           | 0,02              |
| 500 000 1.100% State of North Rhine-Westphalia Germany 13/03/2034 | 410 500          | 0,09              | 100 000 0.750% State of Saxony-Anhalt 29/01/2029                  | 88 427           | 0,02              |
| 100 000 0.000% State of North Rhine-Westphalia Germany 12/10/2035 | 67 961           | 0,01              | 100 000 0.125% State of Saxony-Anhalt 21/06/2029                  | 84 187           | 0,02              |
| 150 000 1.250% State of North Rhine-Westphalia Germany 12/05/2036 | 119 646          | 0,03              | 100 000 0.500% State of Saxony-Anhalt 24/03/2051                  | 51 840           | 0,01              |
| 100 000 1.650% State of North Rhine-Westphalia Germany 22/02/2038 | 81 891           | 0,02              | 100 000 0.010% State of Schleswig-Holstein Germany 16/07/2025     | 93 191           | 0,02              |
| 200 000 0.500% State of North Rhine-Westphalia Germany 25/11/2039 | 130 612          | 0,03              | 100 000 0.500% State of Schleswig-Holstein Germany 19/05/2026     | 92 433           | 0,02              |
| 100 000 0.750% State of North Rhine-Westphalia Germany 16/08/2041 | 65 605           | 0,01              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR   | % des actifs nets |
|---|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,00 % (mars 2022 : 99,17 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Obligations d'État – 62,54 % (mars 2022 : 64,31 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Euro – 62,54 % (suite)</b>                                     |                    |                   |
| 100 000 0.375% State of Schleswig-Holstein Germany 08/02/2027     | 90 511             | 0,02              |
| 100 000 1.375% State of Schleswig-Holstein Germany 14/07/2027     | 93 600             | 0,02              |
| 100 000 0.625% State of Schleswig-Holstein Germany 31/08/2028     | 88 553             | 0,02              |
| 100 000 1.375% State of the Grand-Duchy of Luxembourg 25/05/2029  | 91 624             | 0,02              |
| 100 000 0.000% State of the Grand-Duchy of Luxembourg 24/03/2031  | 79 610             | 0,02              |
| 100 000 0.000% State of the Grand-Duchy of Luxembourg 14/09/2032  | 76 220             | 0,02              |
| 200 000 2.375% UNEDIC ASSEO 25/05/2024                            | 197 696            | 0,04              |
| 200 000 0.125% UNEDIC ASSEO 25/11/2024                            | 189 984            | 0,04              |
| 100 000 0.625% UNEDIC ASSEO 17/02/2025                            | 95 466             | 0,02              |
| 100 000 0.625% UNEDIC ASSEO 03/03/2026                            | 93 230             | 0,02              |
| 200 000 0.100% UNEDIC ASSEO 25/11/2026                            | 180 114            | 0,04              |
| 100 000 1.250% UNEDIC ASSEO 21/10/2027                            | 92 740             | 0,02              |
| 200 000 0.875% UNEDIC ASSEO 25/05/2028                            | 180 404            | 0,04              |
| 100 000 0.000% UNEDIC ASSEO 25/11/2028                            | 84 775             | 0,02              |
| 100 000 0.000% UNEDIC ASSEO 05/03/2030                            | 81 813             | 0,02              |
| 300 000 0.000% UNEDIC ASSEO 19/11/2030                            | 240 501            | 0,05              |
| 100 000 0.010% UNEDIC ASSEO 25/05/2031                            | 79 129             | 0,02              |
| 100 000 1.500% UNEDIC ASSEO 20/04/2032                            | 88 446             | 0,02              |
| 200 000 0.100% UNEDIC ASSEO 25/05/2034                            | 142 730            | 0,03              |
| 200 000 0.250% UNEDIC ASSEO 16/07/2035                            | 140 368            | 0,03              |
| 100 000 3.000% Ville de Paris 27/09/2042                          | 92 416             | 0,02              |
| <b>Total des obligations d'État</b>                               | <b>294 978 069</b> | <b>62,54</b>      |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>                               | <b>466 979 214</b> | <b>99,00</b>      |

| Analyse du total des actifs (non auditée)  | % du total des actifs |
|--|-----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs            | 94,26                 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé                        | 2,17                  |
| Autres valeurs mobilières du type mentionné dans le Règlement 68(1)(a), (b) et (c) | 1,52                  |
| Autres actifs  | 2,05                  |
| <b>Total des actifs</b>  | <b>100,00</b>         |

|   | Juste valeur EUR   | % du Comp.    |
|---|--------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | <b>466 979 214</b> | <b>99,00</b>  |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,16 %)</b>                               | <b>591 178</b>     | <b>0,13</b>   |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : 0,67 %)</b>                                      | <b>4 103 893</b>   | <b>0,87</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>471 674 285</b> | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

## SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>EUR          | 2022<br>EUR          |             |
|---|-------|----------------------|----------------------|-------------|
| <b>Actifs circulants</b>  |       |                      |                      |             |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :            |       |                      |                      |             |
|   | 1(e)  |                      |                      |             |
| Valeurs mobilières  |       | 1 029 402 267        | 1 090 141 178        |             |
|   |       | <b>1 029 402 267</b> | <b>1 090 141 178</b> |             |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie   |       |                      |                      |             |
|   | 1(f)  | 3 536 910            | 2 501 943            |             |
| Créances :  |       |                      |                      |             |
| Intérêts à recevoir   |       | 9 183 660            | 8 904 031            |             |
| À recevoir sur cessions d'investissements   |       | 17 335 073           | 17 561 846           |             |
|   |       | <b>1 059 457 910</b> | <b>1 119 108 998</b> |             |
| <b>Total des actifs circulants</b>  |       |                      |                      |             |
| <b>Passifs circulants</b>   |       |                      |                      |             |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :  |       |                      |                      |             |
| Charges à payer   |       | (100 554)            | (125 929)            |             |
| À payer sur achats d'investissements  |       | (20 071 802)         | (16 595 527)         |             |
|   |       | <b>(20 172 356)</b>  | <b>(16 721 456)</b>  |             |
| <b>Total des passifs circulants</b>   |       |                      |                      |             |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> |       |                      |                      |             |
|   |       | <b>1 039 285 554</b> | <b>1 102 387 542</b> |             |
|   |       | <b>2023</b>          | <b>2022</b>          | <b>2021</b> |
| Valeur liquidative par action   |       |                      |                      |             |
| Catégorie non couverte en EUR (Acc)   | 5     | 24,16 EUR            | 27,41 EUR            | 29,30 EUR   |
| Catégorie non couverte en EUR (Dist)  | 5     | 55,03 EUR            | 62,74 EUR            | 67,16 EUR   |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>EUR          | 2022<br>EUR         |
|---|-------|----------------------|---------------------|
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 7 482 557            | 3 016 821           |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 9     | (138 413 142)        | (78 445 884)        |
| Produits divers   |       | 5 712                | -                   |
| <b>Total des charges d'investissement</b>   |       | <b>(130 924 873)</b> | <b>(75 429 063)</b> |
| Charges opérationnelles   | 3     | (1 232 688)          | (1 549 383)         |
| <b>Perte nette pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(132 157 561)</b> | <b>(76 978 446)</b> |
| <b>Charges financières</b>  |       |                      |                     |
| Charges d'intérêts  |       | (8 922)              | (18 442)            |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables   | 7     | (1 405 471)          | (527 695)           |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(133 571 954)</b> | <b>(77 524 583)</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>EUR                 | 2022<br>EUR                 |
|---|-----------------------------|-----------------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier               | 1 102 387 542               | 1 328 658 848               |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(133 571 954)</b>        | <b>(77 524 583)</b>         |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                             |                             |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 506 456 841                 | 395 418 767                 |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | <u>(435 986 875)</u>        | <u>(544 165 490)</u>        |
| Augmentation/(Diminution) des actifs nets résultant d'opérations sur actions  | <u>70 469 966</u>           | <u>(148 746 723)</u>        |
| <b>Diminution totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                   | <b><u>(63 101 988)</u></b>  | <b><u>(226 271 306)</u></b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>        | <b><u>1 039 285 554</u></b> | <b><u>1 102 387 542</u></b> |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>EUR          | 2022<br>EUR          |
|---|-------|----------------------|----------------------|
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(133 571 954)</b> | <b>(77 524 583)</b>  |
| <b>Ajustement pour :</b>  |       |                      |                      |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  |       | 64 441 959           | 225 920 519          |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   |       | <b>(69 129 995)</b>  | <b>148 395 936</b>   |
| Variation des montants à recevoir   |       | (279 629)            | 1 747 506            |
| Variation des montants à payer  |       | (25 375)             | (21 234)             |
| <b>(Sorties)/Entrées de trésorerie sur opérations</b>   |       | <b>(305 004)</b>     | <b>1 726 272</b>     |
| <b>(Sorties)/Entrées de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  |       | <b>(69 434 999)</b>  | <b>150 122 208</b>   |
| <b>Activités de financement</b>   |       |                      |                      |
| Produits des souscriptions  | 5     | 506 456 841          | 395 418 767          |
| Paiements sur rachats   | 5     | (435 986 875)        | (544 165 490)        |
| <b>Trésorerie nette générée/(utilisée) sur activités de financement</b>   |       | <b>70 469 966</b>    | <b>(148 746 723)</b> |
| <b>Augmentation nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>   |       | <b>1 034 967</b>     | <b>1 375 485</b>     |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  |       | 2 501 943            | 1 126 458            |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   |       | <b>3 536 910</b>     | <b>2 501 943</b>     |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |       |                      |                      |
| Intérêts reçus  |       | 19 265 711           | 22 894 655           |
| Intérêts payés  |       | (8 922)              | (18 442)             |
| Distributions payées  |       | (1 405 471)          | (527 695)            |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.



## SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement   | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %)</b>            |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b>    |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %)</b>            |                  |                   | <b>Obligations d'État – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b>    |                  |                   |
| <b>Euro – 99,05 %</b>  |                  |                   | <b>Euro – 99,05 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 2 987 000 0.000% Bundesobligation 05/04/2024                         | 2 903 872        | 0,28              | 5 738 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2030 | 4 879 348        | 0,47              |
| 4 215 000 0.000% Bundesobligation 18/10/2024                         | 4 044 082        | 0,39              | 3 423 000 5.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/01/2031 | 4 201 972        | 0,40              |
| 3 787 000 0.000% Bundesobligation 11/04/2025                         | 3 591 250        | 0,35              | 3 388 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2031 | 2 846 564        | 0,27              |
| 4 447 000 0.000% Bundesobligation 10/10/2025                         | 4 175 655        | 0,40              | 4 574 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2031 | 3 801 725        | 0,36              |
| 2 708 000 0.000% Bundesobligation 10/04/2026                         | 2 515 694        | 0,24              | 6 706 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2032 | 5 508 174        | 0,53              |
| 2 506 000 0.000% Bundesobligation 09/10/2026                         | 2 304 417        | 0,22              | 5 320 000 1.700% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2032 | 5 069 694        | 0,49              |
| 5 108 000 0.000% Bundesobligation 16/04/2027                         | 4 648 280        | 0,45              | 3 490 000 2.300% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2033 | 3 487 170        | 0,34              |
| 6 420 000 1.300% Bundesobligation 15/10/2027                         | 6 139 732        | 0,59              | 2 500 000 4.750% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2034 | 3 091 100        | 0,30              |
| 2 740 000 2.200% Bundesobligation 13/04/2028                         | 2 720 902        | 0,26              | 4 700 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/05/2035 | 3 537 925        | 0,34              |
| 3 140 000 1.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/05/2024 | 3 096 103        | 0,30              | 2 700 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/05/2036 | 1 976 589        | 0,19              |
| 2 485 000 1.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2024 | 2 427 050        | 0,23              | 4 924 000 4.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/01/2037 | 5 836 319        | 0,56              |
| 5 825 000 0.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2025 | 5 597 883        | 0,54              | 910 000 1.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/05/2038   | 744 096          | 0,07              |
| 6 299 000 1.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2025 | 6 070 472        | 0,58              | 3 173 000 4.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2039 | 3 939 565        | 0,38              |
| 6 085 000 0.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2026 | 5 752 090        | 0,55              | 2 331 000 4.750% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2040 | 3 085 312        | 0,30              |
| 4 806 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2026 | 4 434 977        | 0,43              | 4 177 000 3.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2042 | 4 695 742        | 0,45              |
| 3 484 000 0.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2027 | 3 215 767        | 0,31              | 4 083 000 2.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2044 | 4 157 066        | 0,40              |
| 1 803 000 6.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2027 | 2 100 639        | 0,20              | 5 787 000 2.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2046 | 5 937 751        | 0,57              |
| 3 396 000 0.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2027 | 3 141 741        | 0,30              | 5 376 000 1.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2048 | 4 295 532        | 0,41              |
| 3 370 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/11/2027 | 3 030 540        | 0,29              | 6 938 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2050 | 3 750 832        | 0,36              |
| 2 585 000 5.625% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/01/2028 | 2 963 651        | 0,29              | 3 030 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2052 | 1 559 935        | 0,15              |
| 4 290 000 0.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2028 | 3 936 247        | 0,38              | 1 914 000 1.800% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2053 | 1 681 028        | 0,16              |
| 2 080 000 4.750% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2028 | 2 327 437        | 0,22              | 2 110 000 0.200% Bundesschatzanweisungen 14/06/2024                  | 2 045 856        | 0,20              |
| 4 601 000 0.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2028 | 4 131 790        | 0,40              | 3 220 000 0.400% Bundesschatzanweisungen 13/09/2024                  | 3 113 804        | 0,30              |
| 4 780 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/11/2028 | 4 211 562        | 0,41              | 2 260 000 2.200% Bundesschatzanweisungen 12/12/2024                  | 2 239 796        | 0,22              |
| 6 069 000 0.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2029 | 5 402 017        | 0,52              | 1 790 000 2.500% Bundesschatzanweisungen 13/03/2025                  | 1 783 073        | 0,17              |
| 4 588 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2029 | 3 977 842        | 0,38              |  |                  |                   |
| 1 280 000 2.100% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/11/2029 | 1 264 576        | 0,12              |  |                  |                   |
| 2 780 000 6.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/01/2030 | 3 468 884        | 0,33              |  |                  |                   |
| 4 454 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2030 | 3 823 937        | 0,37              |  |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 99,05 % (suite)</b>                                     |                  |                   | <b>Euro – 99,05 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 2 130 000 1.500% Croatia Government International Bond 17/06/2031 | 1 794 099        | 0,17              | 80 000 2.750% Finland Government Bond 15/04/2038                  | 76 395           | 0,01              |
| 120 000 2.750% Cyprus Government International Bond 27/06/2024    | 119 872          | 0,01              | 463 000 0.250% Finland Government Bond 15/09/2040                 | 288 819          | 0,03              |
| 200 000 0.625% Cyprus Government International Bond 03/12/2024    | 192 160          | 0,02              | 701 000 2.625% Finland Government Bond 04/07/2042                 | 662 172          | 0,06              |
| 840 000 0.625% Cyprus Government International Bond 21/01/2030    | 679 619          | 0,07              | 1 312 000 0.500% Finland Government Bond 15/04/2043               | 819 974          | 0,08              |
| 279 000 2.750% Cyprus Government International Bond 26/02/2034    | 243 397          | 0,02              | 512 000 1.375% Finland Government Bond 15/04/2047                 | 380 733          | 0,04              |
| 100 000 1.250% Cyprus Government International Bond 21/01/2040    | 64 403           | 0,01              | 822 000 0.125% Finland Government Bond 15/04/2052                 | 389 316          | 0,04              |
| 250 000 2.750% Cyprus Government International Bond 03/05/2049    | 198 595          | 0,02              | 4 336 000 2.250% French Republic Government Bond OAT 25/05/2024   | 4 299 231        | 0,41              |
| 238 000 0.125% Estonia Government International Bond 10/06/2030   | 188 170          | 0,02              | 5 157 000 1.750% French Republic Government Bond OAT 25/11/2024   | 5 066 495        | 0,49              |
| 300 000 4.000% Estonia Government International Bond 12/10/2032   | 308 226          | 0,03              | 6 028 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/02/2025   | 5 718 643        | 0,55              |
| 1 195 000 2.000% Finland Government Bond 15/04/2024               | 1 183 480        | 0,11              | 9 018 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/03/2025   | 8 539 415        | 0,82              |
| 1 266 000 0.000% Finland Government Bond 15/09/2024               | 1 215 213        | 0,12              | 6 925 000 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2025   | 6 602 018        | 0,64              |
| 700 000 4.000% Finland Government Bond 04/07/2025                 | 718 865          | 0,07              | 5 517 000 6.000% French Republic Government Bond OAT 25/10/2025   | 5 955 988        | 0,57              |
| 440 000 0.875% Finland Government Bond 15/09/2025                 | 420 979          | 0,04              | 7 259 000 1.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2025   | 6 949 198        | 0,67              |
| 408 000 0.500% Finland Government Bond 15/04/2026                 | 383 977          | 0,04              | 6 940 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/02/2026   | 6 428 175        | 0,62              |
| 740 000 0.000% Finland Government Bond 15/09/2026                 | 676 108          | 0,07              | 6 766 000 3.500% French Republic Government Bond OAT 25/04/2026   | 6 927 166        | 0,67              |
| 1 364 000 0.500% Finland Government Bond 15/09/2027               | 1 244 173        | 0,12              | 6 244 000 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2026   | 5 840 201        | 0,56              |
| 421 000 2.750% Finland Government Bond 04/07/2028                 | 422 532          | 0,04              | 7 398 000 0.250% French Republic Government Bond OAT 25/11/2026   | 6 789 810        | 0,65              |
| 1 328 000 0.500% Finland Government Bond 15/09/2028               | 1 181 402        | 0,11              | 5 070 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/02/2027   | 4 580 035        | 0,44              |
| 1 894 000 0.500% Finland Government Bond 15/09/2029               | 1 644 465        | 0,16              | 7 591 000 1.000% French Republic Government Bond OAT 25/05/2027   | 7 102 747        | 0,68              |
| 580 000 0.000% Finland Government Bond 15/09/2030                 | 472 601          | 0,05              | 6 854 000 2.750% French Republic Government Bond OAT 25/10/2027   | 6 886 351        | 0,66              |
| 903 000 0.750% Finland Government Bond 15/04/2031                 | 769 907          | 0,07              | 5 520 000 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/02/2028   | 5 040 119        | 0,48              |
| 679 000 0.125% Finland Government Bond 15/09/2031                 | 542 691          | 0,05              | 10 523 000 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/05/2028  | 9 574 986        | 0,92              |
| 1 550 000 1.500% Finland Government Bond 15/09/2032               | 1 376 958        | 0,13              | 9 221 000 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/11/2028   | 8 316 789        | 0,80              |
| 590 000 1.125% Finland Government Bond 15/04/2034                 | 489 134          | 0,05              | 6 224 000 5.500% French Republic Government Bond OAT 25/04/2029   | 7 195 068        | 0,69              |
| 571 000 0.125% Finland Government Bond 15/04/2036                 | 392 009          | 0,04              | 8 034 000 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2029   | 7 065 983        | 0,68              |

## SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 99,05 % (suite)</b>                                     |                  |                   | <b>Euro – 99,05 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 8 786 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2029   | 7 383 403        | 0,71              | 2 662 000 4.000% French Republic Government Bond OAT 25/04/2060   | 3 094 495        | 0,30              |
| 8 246 000 2.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2030   | 8 168 240        | 0,79              | 3 294 000 1.750% French Republic Government Bond OAT 25/05/2066   | 2 262 029        | 0,22              |
| 7 999 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2030   | 6 532 063        | 0,63              | 1 696 000 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2072   | 671 836          | 0,06              |
| 9 510 000 1.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2031   | 8 708 212        | 0,84              | 1 751 000 5.400% Ireland Government Bond 13/03/2025               | 1 842 322        | 0,18              |
| 7 844 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2031   | 6 213 781        | 0,60              | 1 435 000 1.000% Ireland Government Bond 15/05/2026               | 1 366 622        | 0,13              |
| 7 562 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/05/2032   | 5 889 361        | 0,57              | 1 022 000 0.200% Ireland Government Bond 15/05/2027               | 926 320          | 0,09              |
| 4 920 000 5.750% French Republic Government Bond OAT 25/10/2032   | 6 134 748        | 0,59              | 1 353 000 0.900% Ireland Government Bond 15/05/2028               | 1 241 662        | 0,12              |
| 6 086 000 2.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2032   | 5 675 925        | 0,55              | 2 408 000 1.100% Ireland Government Bond 15/05/2029               | 2 204 428        | 0,21              |
| 8 580 000 1.250% French Republic Government Bond OAT 25/05/2034   | 7 202 993        | 0,69              | 1 400 000 2.400% Ireland Government Bond 15/05/2030               | 1 383 522        | 0,13              |
| 4 610 000 4.750% French Republic Government Bond OAT 25/04/2035   | 5 420 484        | 0,52              | 1 640 000 0.200% Ireland Government Bond 18/10/2030               | 1 368 892        | 0,13              |
| 6 662 000 1.250% French Republic Government Bond OAT 25/05/2036   | 5 372 903        | 0,52              | 855 000 1.350% Ireland Government Bond 18/03/2031                 | 776 126          | 0,07              |
| 100 000 1.250% French Republic Government Bond OAT 25/05/2038     | 77 673           | 0,01              | 804 000 0.000% Ireland Government Bond 18/10/2031                 | 638 440          | 0,06              |
| 5 152 000 4.000% French Republic Government Bond OAT 25/10/2038   | 5 702 388        | 0,55              | 905 000 1.300% Ireland Government Bond 15/05/2033                 | 788 011          | 0,08              |
| 3 659 000 1.750% French Republic Government Bond OAT 25/06/2039   | 3 048 470        | 0,29              | 1 645 000 0.400% Ireland Government Bond 15/05/2035               | 1 218 698        | 0,12              |
| 1 680 000 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2040   | 1 095 410        | 0,11              | 1 089 000 1.700% Ireland Government Bond 15/05/2037               | 922 503          | 0,09              |
| 5 705 000 4.500% French Republic Government Bond OAT 25/04/2041   | 6 733 611        | 0,65              | 380 000 0.550% Ireland Government Bond 22/04/2041                 | 245 822          | 0,02              |
| 1 760 000 2.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2043   | 1 574 091        | 0,15              | 580 000 3.000% Ireland Government Bond 18/10/2043                 | 570 923          | 0,05              |
| 4 650 000 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/06/2044   | 2 776 189        | 0,27              | 1 521 000 2.000% Ireland Government Bond 18/02/2045               | 1 242 916        | 0,12              |
| 4 752 000 3.250% French Republic Government Bond OAT 25/05/2045   | 4 793 675        | 0,46              | 1 279 000 1.500% Ireland Government Bond 15/05/2050               | 895 837          | 0,09              |
| 4 677 000 2.000% French Republic Government Bond OAT 25/05/2048   | 3 721 676        | 0,36              | 4 130 000 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/04/2024     | 3 997 757        | 0,38              |
| 5 005 000 1.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2050   | 3 492 889        | 0,34              | 2 857 000 1.850% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/05/2024     | 2 815 688        | 0,27              |
| 4 030 000 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/05/2052   | 2 205 659        | 0,21              | 1 950 000 1.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 30/05/2024     | 1 916 752        | 0,18              |
| 5 575 000 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/05/2053   | 2 966 792        | 0,29              | 1 150 000 1.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/07/2024     | 1 129 852        | 0,11              |
| 400 000 3.000% French Republic Government Bond OAT 25/05/2054     | 379 752          | 0,04              | 2 140 000 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/08/2024     | 2 050 634        | 0,20              |
| 3 094 000 4.000% French Republic Government Bond OAT 25/04/2055   | 3 552 778        | 0,34              | 3 005 000 3.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2024     | 3 026 486        | 0,29              |

## SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 99,05 % (suite)</b>                                     |                  |                   | <b>Euro – 99,05 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 1 416 000 1.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/11/2024     | 1 378 405        | 0,13              | 4 007 000 6.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/11/2027     | 4 522 180        | 0,44              |
| 3 643 000 2.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2024     | 3 604 348        | 0,35              | 4 386 000 2.650% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2027     | 4 226 481        | 0,41              |
| 2 390 000 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/12/2024     | 2 265 290        | 0,22              | 3 209 000 2.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/02/2028     | 2 996 019        | 0,29              |
| 2 770 000 0.350% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/02/2025     | 2 630 558        | 0,25              | 4 760 000 0.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/03/2028     | 4 053 949        | 0,39              |
| 5 150 000 5.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2025     | 5 315 624        | 0,51              | 2 630 000 3.400% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/04/2028     | 2 607 093        | 0,25              |
| 3 535 000 1.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/05/2025     | 3 407 917        | 0,33              | 4 130 000 0.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/07/2028     | 3 522 312        | 0,34              |
| 3 590 000 1.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/06/2025     | 3 458 462        | 0,33              | 3 179 000 4.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2028     | 3 362 905        | 0,32              |
| 2 235 000 1.850% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/07/2025     | 2 167 794        | 0,21              | 4 097 000 2.800% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2028     | 3 931 686        | 0,38              |
| 3 610 000 1.200% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/08/2025     | 3 438 778        | 0,33              | 2 300 000 0.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/02/2029     | 1 914 865        | 0,18              |
| 2 791 000 2.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/11/2025     | 2 735 515        | 0,26              | 960 000 2.800% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/06/2029       | 912 298          | 0,09              |
| 3 130 000 2.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2025     | 3 024 769        | 0,29              | 3 663 000 3.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2029     | 3 525 235        | 0,34              |
| 2 470 000 3.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/01/2026     | 2 477 632        | 0,24              | 4 736 000 5.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/11/2029     | 5 173 985        | 0,50              |
| 2 120 000 0.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/02/2026     | 1 957 926        | 0,19              | 1 810 000 3.850% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/12/2029     | 1 816 299        | 0,17              |
| 4 139 000 4.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2026     | 4 269 461        | 0,41              | 4 658 000 3.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2030     | 4 592 648        | 0,44              |
| 1 598 000 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/04/2026     | 1 446 286        | 0,14              | 3 889 000 1.350% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/04/2030     | 3 313 195        | 0,32              |
| 3 342 000 1.600% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/06/2026     | 3 167 247        | 0,30              | 3 128 000 0.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2030     | 2 560 393        | 0,25              |
| 2 066 000 2.100% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/07/2026     | 1 985 798        | 0,19              | 2 817 000 1.650% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2030     | 2 412 056        | 0,23              |
| 4 286 000 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2026     | 3 833 913        | 0,37              | 1 828 000 0.900% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/04/2031     | 1 460 462        | 0,14              |
| 2 002 000 7.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/11/2026     | 2 260 819        | 0,22              | 4 807 000 6.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/05/2031     | 5 528 867        | 0,53              |
| 3 047 000 1.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2026     | 2 825 575        | 0,27              | 2 847 000 0.600% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2031     | 2 188 485        | 0,21              |
| 2 370 000 0.850% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/01/2027     | 2 157 553        | 0,21              | 2 914 000 0.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2031     | 2 286 412        | 0,22              |
| 3 900 000 1.100% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/04/2027     | 3 565 965        | 0,34              | 3 911 000 1.650% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2032     | 3 253 639        | 0,31              |
| 2 455 000 2.200% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/06/2027     | 2 338 829        | 0,23              | 3 166 000 0.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/06/2032     | 2 444 089        | 0,24              |
| 3 742 000 2.050% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2027     | 3 532 908        | 0,34              | 3 600 000 2.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2032     | 3 173 040        | 0,31              |
| 2 030 000 0.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/09/2027     | 1 821 681        | 0,18              | 3 188 000 5.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/02/2033     | 3 618 922        | 0,35              |

## SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 99,05 % (suite)</b>                                     |                  |                   | <b>Euro – 99,05 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 2 770 000 4.400% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/05/2033     | 2 842 851        | 0,27              | 770 000 4.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/10/2053       | 773 996          | 0,07              |
| 3 565 000 2.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2033     | 3 074 812        | 0,30              | 1 721 000 2.800% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2067     | 1 206 421        | 0,12              |
| 3 999 000 5.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2034     | 4 291 207        | 0,41              | 1 507 000 2.150% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2072     | 879 998          | 0,08              |
| 2 086 000 3.350% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2035     | 1 913 968        | 0,18              | 1 999 000 2.600% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2024    | 1 992 383        | 0,19              |
| 2 570 000 4.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 30/04/2035     | 2 513 357        | 0,24              | 1 259 000 0.500% Kingdom of Belgium Government Bond 22/10/2024    | 1 216 056        | 0,12              |
| 2 450 000 1.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2036     | 1 793 032        | 0,17              | 4 814 000 0.800% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2025    | 4 619 418        | 0,44              |
| 2 752 000 2.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2036     | 2 210 957        | 0,21              | 2 106 000 4.500% Kingdom of Belgium Government Bond 28/03/2026    | 2 215 449        | 0,21              |
| 4 782 000 4.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/02/2037     | 4 674 692        | 0,45              | 2 452 000 1.000% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2026    | 2 327 698        | 0,22              |
| 1 880 000 0.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2037     | 1 246 064        | 0,12              | 2 006 000 0.800% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2027    | 1 859 121        | 0,18              |
| 1 580 000 3.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2038     | 1 394 208        | 0,13              | 1 318 000 0.000% Kingdom of Belgium Government Bond 22/10/2027    | 1 170 081        | 0,11              |
| 1 751 000 2.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2038     | 1 491 257        | 0,14              | 3 565 000 5.500% Kingdom of Belgium Government Bond 28/03/2028    | 4 037 969        | 0,39              |
| 4 800 000 5.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2039     | 5 162 736        | 0,50              | 2 182 000 0.800% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2028    | 1 990 224        | 0,19              |
| 1 501 000 3.100% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2040     | 1 281 194        | 0,12              | 3 615 000 0.900% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2029    | 3 254 259        | 0,31              |
| 3 409 000 5.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2040     | 3 678 277        | 0,35              | 1 672 000 0.100% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2030    | 1 385 586        | 0,13              |
| 1 583 000 1.800% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2041     | 1 092 048        | 0,11              | 2 827 000 1.000% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2031    | 2 453 553        | 0,24              |
| 1 190 000 4.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2043     | 1 192 535        | 0,11              | 2 351 000 0.000% Kingdom of Belgium Government Bond 22/10/2031    | 1 846 875        | 0,18              |
| 3 534 000 4.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2044     | 3 711 053        | 0,36              | 1 590 000 4.000% Kingdom of Belgium Government Bond 28/03/2032    | 1 729 141        | 0,17              |
| 2 900 000 1.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 30/04/2045     | 1 756 791        | 0,17              | 3 020 000 0.350% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2032    | 2 403 497        | 0,23              |
| 2 868 000 3.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2046     | 2 420 994        | 0,23              | 1 736 000 1.250% Kingdom of Belgium Government Bond 22/04/2033    | 1 491 102        | 0,14              |
| 1 935 000 2.700% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2047     | 1 479 114        | 0,14              | 1 090 000 3.000% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2033    | 1 093 128        | 0,11              |
| 3 010 000 3.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2048     | 2 607 533        | 0,25              | 1 256 000 3.000% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2034    | 1 249 004        | 0,12              |
| 2 478 000 3.850% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2049     | 2 277 133        | 0,22              | 2 552 000 5.000% Kingdom of Belgium Government Bond 28/03/2035    | 3 033 282        | 0,29              |
| 2 248 000 2.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2050     | 1 579 377        | 0,15              | 1 144 000 1.450% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2037    | 920 840          | 0,09              |
| 1 936 000 1.700% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2051     | 1 139 665        | 0,11              | 1 585 000 1.900% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2038    | 1 337 883        | 0,13              |
| 1 006 000 2.150% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2052     | 648 659          | 0,06              | 1 000 000 2.750% Kingdom of Belgium Government Bond 22/04/2039    | 939 590          | 0,09              |

## SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR  | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets                                   |           |      |
|---|---|-------------------|---|------------------|---|-----------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |   |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |   |           |      |
| <b>Obligations d'État – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |   |                   | <b>Obligations d'État – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |   |           |      |
| <b>Euro – 99,05 % (suite)</b>                                     |   |                   | <b>Euro – 99,05 % (suite)</b>                                     |                  |   |           |      |
| 2 114 000   | 0.400% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2040      | 1 325 943         | 0,13  | 1 419 000        | 0.000% Netherlands Government Bond 15/01/2026       | 1 320 379 | 0,13 |
| 1 541 000   | 4.250% Kingdom of Belgium Government Bond 28/03/2041      | 1 741 946         | 0,17  | 2 477 000        | 0.500% Netherlands Government Bond 15/07/2026       | 2 317 432 | 0,22 |
| 1 373 000   | 3.750% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2045      | 1 466 721         | 0,14  | 3 645 000        | 0.000% Netherlands Government Bond 15/01/2027       | 3 314 471 | 0,32 |
| 2 909 000   | 1.600% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2047      | 2 089 273         | 0,20  | 3 147 000        | 0.750% Netherlands Government Bond 15/07/2027       | 2 920 322 | 0,28 |
| 1 531 000   | 1.700% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2050      | 1 094 772         | 0,11  | 2 249 000        | 5.500% Netherlands Government Bond 15/01/2028       | 2 542 719 | 0,24 |
| 3 140 000   | 1.400% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2053      | 2 002 378         | 0,19  | 2 473 000        | 0.750% Netherlands Government Bond 15/07/2028       | 2 258 195 | 0,22 |
| 213 000   | 2.250% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2057      | 167 603           | 0,02  | 300 000          | 0.000% Netherlands Government Bond 15/01/2029       | 259 407   | 0,02 |
| 357 000   | 2.150% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2066      | 270 224           | 0,03  | 2 004 000        | 0.250% Netherlands Government Bond 15/07/2029       | 1 740 815 | 0,17 |
| 1 802 000   | 0.650% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2071      | 757 038           | 0,07  | 558 000          | 0.000% Netherlands Government Bond 15/07/2030       | 464 295   | 0,04 |
| 320 000   | 2.875% Latvia Government International Bond 30/04/2024    | 317 683           | 0,03  | 3 666 000        | 0.000% Netherlands Government Bond 15/07/2031       | 2 973 126 | 0,29 |
| 960 000   | 3.875% Latvia Government International Bond 25/03/2027    | 969 850           | 0,09  | 3 580 000        | 0.500% Netherlands Government Bond 15/07/2032       | 2 969 932 | 0,29 |
| 200 000   | 1.375% Latvia Government International Bond 16/05/2036    | 147 616           | 0,01  | 2 840 000        | 2.500% Netherlands Government Bond 15/01/2033       | 2 812 764 | 0,27 |
| 500 000   | 1.875% Latvia Government International Bond 19/02/2049    | 352 395           | 0,03  | 1 000 000        | 2.500% Netherlands Government Bond 15/07/2033       | 986 850   | 0,09 |
| 245 000   | 1.250% Lithuania Government International Bond 22/10/2025 | 230 187           | 0,02  | 1 411 000        | 4.000% Netherlands Government Bond 15/01/2037       | 1 613 225 | 0,16 |
| 790 000   | 0.500% Lithuania Government International Bond 19/06/2029 | 652 200           | 0,06  | 1 000 000        | 0.000% Netherlands Government Bond 15/01/2038       | 668 940   | 0,06 |
| 100 000   | 0.750% Lithuania Government International Bond 06/05/2030 | 81 530            | 0,01  | 1 409 000        | 0.500% Netherlands Government Bond 15/01/2040       | 990 442   | 0,10 |
| 350 000   | 2.125% Lithuania Government International Bond 22/10/2035 | 291 687           | 0,03  | 3 545 000        | 3.750% Netherlands Government Bond 15/01/2042       | 4 065 051 | 0,39 |
| 50 000  | 2.100% Lithuania Government International Bond 26/05/2047 | 37 656            | 0,00  | 4 298 000        | 2.750% Netherlands Government Bond 15/01/2047       | 4 379 533 | 0,42 |
| 200 000   | 1.625% Lithuania Government International Bond 19/06/2049 | 129 112           | 0,01  | 2 434 000        | 0.000% Netherlands Government Bond 15/01/2052       | 1 195 151 | 0,12 |
| 240 000   | 0.500% Lithuania Government International Bond 28/07/2050 | 107 076           | 0,01  | 860 000          | 2.000% Netherlands Government Bond 15/01/2054       | 752 294   | 0,07 |
| 100 000   | 0.000% Luxembourg Government Bond 28/04/2025              | 93 774            | 0,01  | 3 453 000        | 2.875% Portugal Obrigaçoes do Tesouro OT 15/10/2025 | 3 468 491 | 0,33 |
| 240 000   | 0.625% Luxembourg Government Bond 01/02/2027              | 219 646           | 0,02  | 966 000          | 2.875% Portugal Obrigaçoes do Tesouro OT 21/07/2026 | 972 192   | 0,09 |
| 392 000   | 2.250% Luxembourg Government Bond 19/03/2028              | 380 103           | 0,04  | 1 362 000        | 4.125% Portugal Obrigaçoes do Tesouro OT 14/04/2027 | 1 435 303 | 0,14 |
| 2 720 000   | 2.000% Netherlands Government Bond 15/07/2024             | 2 694 106         | 0,26  | 1 470 000        | 0.700% Portugal Obrigaçoes do Tesouro OT 15/10/2027 | 1 348 078 | 0,13 |
| 2 577 000   | 0.250% Netherlands Government Bond 15/07/2025             | 2 442 017         | 0,24  | 2 502 000        | 2.125% Portugal Obrigaçoes do Tesouro OT 17/10/2028 | 2 424 763 | 0,23 |

## SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 99,05 % (suite)</b>                                     |                  |                   | <b>Euro – 99,05 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 833 000 1.950% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 15/06/2029       | 793 807          | 0,08              | 1 281 000 2.400% Republic of Austria Government Bond 23/05/2034   | 1 211 826        | 0,12              |
| 1 740 000 3.875% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 15/02/2030     | 1 846 853        | 0,18              | 1 370 000 0.250% Republic of Austria Government Bond 20/10/2036   | 947 409          | 0,09              |
| 1 865 000 0.475% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 18/10/2030     | 1 556 119        | 0,15              | 2 053 000 4.150% Republic of Austria Government Bond 15/03/2037   | 2 298 559        | 0,22              |
| 1 190 000 0.300% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 17/10/2031     | 948 739          | 0,09              | 1 386 000 0.000% Republic of Austria Government Bond 20/10/2040   | 812 473          | 0,08              |
| 2 140 000 1.650% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 16/07/2032     | 1 888 807        | 0,18              | 1 055 000 3.150% Republic of Austria Government Bond 20/06/2044   | 1 080 700        | 0,10              |
| 530 000 2.250% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 18/04/2034       | 482 867          | 0,05              | 1 670 000 1.500% Republic of Austria Government Bond 20/02/2047   | 1 243 031        | 0,12              |
| 1 560 000 0.900% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 12/10/2035     | 1 179 438        | 0,11              | 400 000 1.850% Republic of Austria Government Bond 23/05/2049     | 315 072          | 0,03              |
| 1 035 000 4.100% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 15/04/2037     | 1 115 523        | 0,11              | 1 010 000 2.100% Republic of Austria Government Bond 12/12/2049   | 752 773          | 0,07              |
| 390 000 1.150% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 11/04/2042       | 261 737          | 0,03              | 863 000 0.750% Republic of Austria Government Bond 20/03/2051     | 500 911          | 0,05              |
| 1 210 000 4.100% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 15/02/2045     | 1 303 533        | 0,13              | 575 000 3.800% Republic of Austria Government Bond 26/01/2062     | 675 061          | 0,06              |
| 636 000 1.000% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 12/04/2052       | 338 753          | 0,03              | 830 000 0.700% Republic of Austria Government Bond 20/04/2071     | 381 012          | 0,04              |
| 2 844 000 0.000% Republic of Austria Government Bond 15/07/2024   | 2 746 195        | 0,26              | 366 000 1.500% Republic of Austria Government Bond 02/11/2086     | 222 693          | 0,02              |
| 712 000 1.650% Republic of Austria Government Bond 21/10/2024     | 699 419          | 0,07              | 700 000 0.850% Republic of Austria Government Bond 30/06/2120     | 300 608          | 0,03              |
| 1 300 000 0.000% Republic of Austria Government Bond 20/04/2025   | 1 228 812        | 0,12              | 110 000 0.000% Slovakia Government Bond 17/06/2024                | 106 102          | 0,01              |
| 1 178 000 1.200% Republic of Austria Government Bond 20/10/2025   | 1 134 791        | 0,11              | 540 000 3.375% Slovakia Government Bond 15/11/2024                | 541 604          | 0,05              |
| 2 109 000 4.850% Republic of Austria Government Bond 15/03/2026   | 2 237 396        | 0,22              | 1 300 000 0.250% Slovakia Government Bond 14/05/2025              | 1 222 689        | 0,12              |
| 3 199 000 0.750% Republic of Austria Government Bond 20/10/2026   | 2 997 943        | 0,29              | 235 000 4.350% Slovakia Government Bond 14/10/2025                | 241 596          | 0,02              |
| 3 152 000 0.500% Republic of Austria Government Bond 20/04/2027   | 2 889 785        | 0,28              | 239 000 0.625% Slovakia Government Bond 22/05/2026                | 221 708          | 0,02              |
| 1 481 000 6.250% Republic of Austria Government Bond 15/07/2027   | 1 689 347        | 0,16              | 550 000 1.000% Slovakia Government Bond 12/06/2028                | 491 914          | 0,05              |
| 2 176 000 0.750% Republic of Austria Government Bond 20/02/2028   | 1 984 120        | 0,19              | 880 000 0.750% Slovakia Government Bond 09/04/2030                | 738 936          | 0,07              |
| 1 539 000 0.500% Republic of Austria Government Bond 20/02/2029   | 1 351 134        | 0,13              | 300 000 1.000% Slovakia Government Bond 09/10/2030                | 252 498          | 0,02              |
| 2 700 000 0.000% Republic of Austria Government Bond 20/02/2030   | 2 226 474        | 0,21              | 380 000 1.625% Slovakia Government Bond 21/01/2031                | 334 970          | 0,03              |
| 877 000 0.000% Republic of Austria Government Bond 20/02/2031     | 701 968          | 0,07              | 1 430 000 1.000% Slovakia Government Bond 14/05/2032              | 1 148 991        | 0,11              |
| 3 090 000 0.900% Republic of Austria Government Bond 20/02/2032   | 2 610 803        | 0,25              | 600 000 3.875% Slovakia Government Bond 08/02/2033                | 613 734          | 0,06              |
| 790 000 2.900% Republic of Austria Government Bond 20/02/2033     | 787 369          | 0,08              | 744 000 1.875% Slovakia Government Bond 09/03/2037                | 589 642          | 0,06              |

## SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 99,05 % (suite)</b>                                     |                  |                   | <b>Euro – 99,05 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 560 000 2.000% Slovakia Government Bond<br>17/10/2047             | 401 537          | 0,04              | 3 816 000 2.150% Spain Government Bond<br>31/10/2025              | 3 757 577        | 0,36              |
| 280 000 1.000% Slovakia Government Bond<br>13/10/2051             | 145 757          | 0,01              | 4 673 000 0.000% Spain Government Bond<br>31/01/2026              | 4 312 852        | 0,42              |
| 102 000 2.250% Slovakia Government Bond<br>12/06/2068             | 72 903           | 0,01              | 4 051 000 1.950% Spain Government Bond<br>30/04/2026              | 3 944 783        | 0,38              |
| 710 000 4.625% Slovenia Government Bond<br>09/09/2024             | 735 823          | 0,07              | 3 805 000 5.900% Spain Government Bond<br>30/07/2026              | 4 164 877        | 0,40              |
| 495 000 2.125% Slovenia Government Bond<br>28/07/2025             | 492 292          | 0,05              | 2 812 000 1.300% Spain Government Bond<br>31/10/2026              | 2 666 676        | 0,26              |
| 662 000 1.000% Slovenia Government Bond<br>06/03/2028             | 599 666          | 0,06              | 3 018 000 0.000% Spain Government Bond<br>31/01/2027              | 2 705 214        | 0,26              |
| 180 000 1.188% Slovenia Government Bond<br>14/03/2029             | 161 863          | 0,02              | 2 515 000 1.500% Spain Government Bond<br>30/04/2027              | 2 382 384        | 0,23              |
| 470 000 0.275% Slovenia Government Bond<br>14/01/2030             | 386 279          | 0,04              | 5 088 000 0.800% Spain Government Bond<br>30/07/2027              | 4 658 725        | 0,45              |
| 415 000 0.875% Slovenia Government Bond<br>15/07/2030             | 351 783          | 0,03              | 2 768 000 1.450% Spain Government Bond<br>31/10/2027              | 2 596 273        | 0,25              |
| 460 000 0.125% Slovenia Government Bond<br>01/07/2031             | 359 633          | 0,03              | 3 896 000 0.000% Spain Government Bond<br>31/01/2028              | 3 385 741        | 0,33              |
| 100 000 2.250% Slovenia Government Bond<br>03/03/2032             | 92 150           | 0,01              | 5 310 000 1.400% Spain Government Bond<br>30/04/2028              | 4 926 937        | 0,47              |
| 390 000 3.625% Slovenia Government Bond<br>11/03/2033             | 401 408          | 0,04              | 5 220 000 1.400% Spain Government Bond<br>30/07/2028              | 4 826 882        | 0,46              |
| 410 000 1.500% Slovenia Government Bond<br>25/03/2035             | 329 611          | 0,03              | 4 259 000 5.150% Spain Government Bond<br>31/10/2028              | 4 725 298        | 0,45              |
| 423 000 1.750% Slovenia Government Bond<br>03/11/2040             | 321 962          | 0,03              | 2 476 000 6.000% Spain Government Bond<br>31/01/2029              | 2 873 398        | 0,28              |
| 175 000 3.125% Slovenia Government Bond<br>07/08/2045             | 162 573          | 0,02              | 3 001 000 1.450% Spain Government Bond<br>30/04/2029              | 2 748 976        | 0,26              |
| 340 000 0.488% Slovenia Government Bond<br>20/10/2050             | 166 053          | 0,02              | 1 190 000 0.800% Spain Government Bond<br>30/07/2029              | 1 038 620        | 0,10              |
| 200 000 1.175% Slovenia Government Bond<br>13/02/2062             | 114 790          | 0,01              | 3 867 000 0.600% Spain Government Bond<br>31/10/2029              | 3 318 969        | 0,32              |
| 3 824 000 3.800% Spain Government Bond<br>30/04/2024              | 3 858 722        | 0,37              | 4 296 000 0.500% Spain Government Bond<br>30/04/2030              | 3 611 046        | 0,35              |
| 1 508 000 0.000% Spain Government Bond<br>31/05/2024              | 1 458 357        | 0,14              | 4 325 000 1.950% Spain Government Bond<br>30/07/2030              | 4 014 076        | 0,39              |
| 2 758 000 0.250% Spain Government Bond<br>30/07/2024              | 2 664 173        | 0,26              | 3 857 000 1.250% Spain Government Bond<br>31/10/2030              | 3 385 945        | 0,33              |
| 2 360 000 2.750% Spain Government Bond<br>31/10/2024              | 2 354 407        | 0,23              | 2 277 000 0.100% Spain Government Bond<br>30/04/2031              | 1 793 320        | 0,17              |
| 4 422 000 0.000% Spain Government Bond<br>31/01/2025              | 4 201 013        | 0,40              | 2 001 000 0.500% Spain Government Bond<br>31/10/2031              | 1 606 263        | 0,15              |
| 4 760 000 1.600% Spain Government Bond<br>30/04/2025              | 4 641 809        | 0,45              | 4 839 000 0.700% Spain Government Bond<br>30/04/2032              | 3 896 411        | 0,37              |
| 1 390 000 0.000% Spain Government Bond<br>31/05/2025              | 1 306 391        | 0,13              | 3 844 000 5.750% Spain Government Bond<br>30/07/2032              | 4 631 674        | 0,45              |
| 5 150 000 4.650% Spain Government Bond<br>30/07/2025              | 5 357 442        | 0,52              | 4 500 000 2.550% Spain Government Bond<br>31/10/2032              | 4 242 105        | 0,41              |



## SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                       | Juste valeur EUR     | % des actifs nets |
|--|----------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b>  |                      |                   |
| <b>Obligations d'État – 99,05 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b>  |                      |                   |
| <b>Euro – 99,05 % (suite)</b>                                      |                      |                   |
| 2 160 000 3.150% Spain Government Bond 30/04/2033                  | 2 129 328            | 0,20              |
| 4 628 000 2.350% Spain Government Bond 30/07/2033                  | 4 242 779            | 0,41              |
| 3 682 000 1.850% Spain Government Bond 30/07/2035                  | 3 098 182            | 0,30              |
| 3 147 000 4.200% Spain Government Bond 31/01/2037                  | 3 369 493            | 0,32              |
| 1 700 000 0.850% Spain Government Bond 30/07/2037                  | 1 185 410            | 0,11              |
| 2 858 000 4.900% Spain Government Bond 30/07/2040                  | 3 311 279            | 0,32              |
| 2 366 000 1.200% Spain Government Bond 31/10/2040                  | 1 614 014            | 0,16              |
| 3 173 000 4.700% Spain Government Bond 30/07/2041                  | 3 596 532            | 0,35              |
| 2 998 000 1.000% Spain Government Bond 30/07/2042                  | 1 900 492            | 0,18              |
| 1 730 000 3.450% Spain Government Bond 30/07/2043                  | 1 653 361            | 0,16              |
| 1 223 000 5.150% Spain Government Bond 31/10/2044                  | 1 481 726            | 0,14              |
| 3 387 000 2.900% Spain Government Bond 31/10/2046                  | 2 966 741            | 0,29              |
| 2 763 000 2.700% Spain Government Bond 31/10/2048                  | 2 296 246            | 0,22              |
| 1 786 000 1.000% Spain Government Bond 31/10/2050                  | 959 011              | 0,09              |
| 3 076 000 1.900% Spain Government Bond 31/10/2052                  | 2 042 033            | 0,20              |
| 2 357 000 3.450% Spain Government Bond 30/07/2066                  | 2 169 312            | 0,21              |
| 572 000 1.450% Spain Government Bond 31/10/2071                    | 278 987              | 0,03              |
| 1 200 000 0.000% State of the Grand-Duchy of Luxembourg 24/03/2031 | 955 320              | 0,09              |
| 200 000 0.000% State of the Grand-Duchy of Luxembourg 14/09/2032   | 152 440              | 0,01              |
| 310 000 1.750% State of the Grand-Duchy of Luxembourg 25/05/2042   | 248 918              | 0,02              |
| <b>Total des obligations d'État</b>                                | <b>1 029 402 267</b> | <b>99,05</b>      |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>                                | <b>1 029 402 267</b> | <b>99,05</b>      |

|   | Juste valeur EUR     | % du Comp.    |
|---|----------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | <b>1 029 402 267</b> | <b>99,05</b>  |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,23 %)</b>                               | <b>3 536 910</b>     | <b>0,34</b>   |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : 0,88 %)</b>                                      | <b>6 346 377</b>     | <b>0,61</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>1 039 285 554</b> | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

|  | % du total des actifs |
|--|-----------------------|
| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                                   |                       |
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs            | 91,73                 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé                        | 4,12                  |
| Autres valeurs mobilières du type mentionné dans le Règlement 68(1)(a), (b) et (c) | 1,31                  |
| Autres actifs  | 2,84                  |
| <b>Total des actifs</b>  | <b>100,00</b>         |

## SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>EUR         | 2022<br>EUR         |
|---|-------|---------------------|---------------------|
| <b>Actifs circulants</b>  |       |                     |                     |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :            |       |                     |                     |
| Valeurs mobilières  | 1(e)  | 423 792 706         | 547 835 165         |
|   |       | <b>423 792 706</b>  | <b>547 835 165</b>  |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie   | 1(f)  | 2 286 034           | 19 937 443          |
| Créances :  |       |                     |                     |
| Intérêts à recevoir   |       | 5 946 713           | 6 778 862           |
| À recevoir sur cessions d'investissements   |       | 14 622 137          | 7 359 980           |
| À recevoir sur cessions d'actions de fonds  |       | -                   | 4 325 434           |
| <b>Total des actifs circulants</b>  |       | <b>446 647 590</b>  | <b>586 236 884</b>  |
| <b>Passifs circulants</b>   |       |                     |                     |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :  |       |                     |                     |
| Charges à payer   |       | (145 760)           | (187 640)           |
| À payer sur achats d'investissements  |       | (13 199 878)        | (17 820 263)        |
| À payer sur rachats d'actions de fonds  |       | -                   | (11 490 722)        |
| <b>Total des passifs circulants</b>   |       | <b>(13 345 638)</b> | <b>(29 498 625)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> |       | <b>433 301 952</b>  | <b>556 738 259</b>  |
|   |       | <b>2023</b>         | <b>2022</b>         |
|   |       | <b>2021</b>         |                     |
| Valeur liquidative par action   | 5     | 49,50 EUR           | 54,07 EUR           |
|   |       |                     | 57,19 EUR           |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>EUR         | 2022<br>EUR         |
|---|-------|---------------------|---------------------|
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 20 674 917          | 27 771 051          |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 9     | (43 336 116)        | (38 651 971)        |
| Produits divers   |       | 186 806             | 1 548               |
| <b>Total des charges d'investissement</b>   |       | <b>(22 474 393)</b> | <b>(10 879 372)</b> |
| Charges opérationnelles   | 3     | (1 648 018)         | (3 414 819)         |
| <b>Perte nette pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(24 122 411)</b> | <b>(14 294 191)</b> |
| <b>Charges financières</b>  |       |                     |                     |
| Charges d'intérêts  |       | (10 740)            | (48 644)            |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables   | 7     | (17 924 193)        | (23 754 048)        |
| <b>Perte pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(42 057 344)</b> | <b>(38 096 883)</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement   | 2     | (18 692)            | -                   |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(42 076 036)</b> | <b>(38 096 883)</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>EUR          | 2022<br>EUR          |
|---|----------------------|----------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier               | 556 738 259          | 967 954 931          |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(42 076 036)</b>  | <b>(38 096 883)</b>  |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                      |                      |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 609 904 777          | 559 725 894          |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (691 265 048)        | (932 845 683)        |
| Diminution des actifs nets résultant d'opérations sur actions   | (81 360 271)         | (373 119 789)        |
| <b>Diminution totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                   | <b>(123 436 307)</b> | <b>(411 216 672)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>        | <b>433 301 952</b>   | <b>556 738 259</b>   |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>EUR         | 2022<br>EUR          |
|---|-------|---------------------|----------------------|
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | (42 076 036)        | (38 096 883)         |
| <b>Ajustement pour :</b>  |       |                     |                      |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  |       | 112 159 917         | 399 352 214          |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   |       | <b>70 083 881</b>   | <b>361 255 331</b>   |
| Variation des montants à recevoir   |       | 832 149             | 3 646 484            |
| Variation des montants à payer  |       | (41 880)            | (141 239)            |
| <b>Entrées de trésorerie sur opérations</b>   |       | <b>790 269</b>      | <b>3 505 245</b>     |
| <b>Entrées de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  |       | <b>70 874 150</b>   | <b>364 760 576</b>   |
| <b>Activités de financement</b>   |       |                     |                      |
| Produits des souscriptions  | 5     | 614 230 211         | 572 556 529          |
| Paiements sur rachats   | 5     | (702 755 770)       | (921 354 961)        |
| <b>Trésorerie nette utilisée sur activités de financement</b>   |       | <b>(88 525 559)</b> | <b>(348 798 432)</b> |
| <b>(Diminution)/Augmentation nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>                                    |       | <b>(17 651 409)</b> | <b>15 962 144</b>    |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  |       | 19 937 443          | 3 975 299            |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   |       | <b>2 286 034</b>    | <b>19 937 443</b>    |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |       |                     |                      |
| Impôts payés  |       | (18 692)            | -                    |
| Intérêts reçus  |       | 17 024 097          | 32 302 195           |
| Intérêts payés  |       | (10 740)            | (48 644)             |
| Distributions payées  |       | (17 924 193)        | (23 754 048)         |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement   | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %)</b>  |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b>                                     |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %)</b>  |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b>                               |                  |                   |
| <b>Euro – 97,81 %</b>  |                  |                   | <b>Euro – 97,81 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 850 000 7.558% 888 Acquisitions Ltd 15/07/2027   | 719 857          | 0,17              | 580 000 3.125% Aramark International Finance Sarl 01/04/2025  | 560 141          | 0,13              |
| 1 100 000 1.750% Accor SA 04/02/2026   | 1 053 470        | 0,24              | 1 350 000 5.000% ARD Finance SA 30/06/2027  | 1 008 895        | 0,23              |
| 1 100 000 2.375% Accor SA 29/11/2028   | 973 544          | 0,22              | 830 000 2.000% Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance PLC 01/09/2028 | 684 371          | 0,16              |
| 1 100 000 1.375% ACS Actividades de Construcción y Servicios SA 17/06/2025                               | 1 029 457        | 0,24              | 887 000 3.000% Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance PLC 01/09/2029 | 658 935          | 0,15              |
| 1 130 000 2.625% Adevinta ASA 15/11/2025   | 1 076 103        | 0,25              | 1 950 000 2.125% Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc 15/08/2026                    | 1 705 392        | 0,40              |
| 700 000 3.000% Adevinta ASA 15/11/2027   | 631 036          | 0,15              | 770 000 1.875% Arena Luxembourg Finance Sarl 01/02/2028   | 606 645          | 0,14              |
| 580 000 4.125% Adler Pelzer Holding GmbH 01/04/2024  | 486 695          | 0,11              | 1 080 000 2.000% Ashland Services BV 30/01/2028   | 929 653          | 0,21              |
| 641 000 4.000% Aedas Homes Opco SLU 15/08/2026   | 561 778          | 0,13              | 1 340 000 1.625% Atlantia SpA 03/02/2025  | 1 264 906        | 0,29              |
| 750 000 4.250% Affelou SAS 19/05/2026  | 690 818          | 0,16              | 1 393 000 1.875% Atlantia SpA 13/07/2027  | 1 231 705        | 0,28              |
| 577 000 3.625% Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy 04/02/2028  | 484 253          | 0,11              | 1 915 000 1.875% Atlantia SpA 12/02/2028  | 1 607 872        | 0,37              |
| 620 000 2.875% Akropolis Group Uab 02/06/2026  | 513 577          | 0,12              | 1 200 000 1.750% Atos SE 07/05/2025   | 1 066 848        | 0,25              |
| 770 000 5.250% Albion Financing 1 SARL / Aggreko Holdings Inc 15/10/2026                                 | 698 090          | 0,16              | 600 000 2.500% Atos SE 07/11/2028   | 453 714          | 0,10              |
| 1 372 000 3.625% Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl 01/06/2028 | 1 130 089        | 0,26              | 1 300 000 1.000% Atos SE 12/11/2029   | 872 937          | 0,20              |
| 705 000 4.875% Almviva-The Italian Innovation Co SpA 30/10/2026  | 659 394          | 0,15              | 1 160 000 2.625% Avantor Funding Inc 01/11/2025   | 1 116 280        | 0,26              |
| 490 000 2.125% Almirall SA 30/09/2026  | 449 995          | 0,10              | 640 000 3.875% Avantor Funding Inc 15/07/2028   | 597 747          | 0,14              |
| 990 000 2.250% Altice Financing SA 15/01/2025  | 930 867          | 0,21              | 410 000 4.125% Avis Budget Finance Plc 15/11/2024   | 406 310          | 0,09              |
| 1 930 000 3.000% Altice Financing SA 15/01/2028  | 1 537 322        | 0,35              | 372 000 4.500% Avis Budget Finance Plc 15/05/2025   | 365 758          | 0,08              |
| 1 300 000 4.250% Altice Financing SA 15/08/2029  | 1 045 265        | 0,24              | 638 000 4.750% Avis Budget Finance Plc 30/01/2026   | 621 878          | 0,14              |
| 1 172 000 4.750% Altice Finco SA 15/01/2028  | 880 847          | 0,20              | 750 000 3.750% Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 15/01/2025                                   | 738 960          | 0,17              |
| 2 220 000 8.000% Altice France Holding SA 15/05/2027   | 1 654 699        | 0,38              | 660 000 5.750% Azelis Finance NV 15/03/2028   | 670 976          | 0,15              |
| 870 000 4.000% Altice France Holding SA 15/02/2028   | 569 977          | 0,13              | 480 000 2.125% Azzurra Aeroporti SpA 30/05/2024   | 466 714          | 0,11              |
| 950 000 2.500% Altice France SA/France 15/01/2025  | 883 946          | 0,20              | 530 000 2.625% Azzurra Aeroporti SpA 30/05/2027   | 467 958          | 0,11              |
| 810 000 2.125% Altice France SA/France 15/02/2025  | 747 760          | 0,17              | 880 000 1.500% Ball Corp 15/03/2027   | 787 917          | 0,18              |
| 1 680 000 5.875% Altice France SA/France 01/02/2027  | 1 489 488        | 0,34              | 360 000 1.750% Banca IFIS SpA 25/06/2024  | 346 309          | 0,08              |
| 1 590 000 3.375% Altice France SA/France 15/01/2028  | 1 241 472        | 0,29              | 760 000 6.125% Banca IFIS SpA 19/01/2027  | 746 510          | 0,17              |
| 885 000 4.125% Altice France SA/France 15/01/2029  | 681 724          | 0,16              | 1 140 000 3.625% Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 24/09/2024                                       | 1 080 446        | 0,25              |
| 700 000 4.000% Altice France SA/France 15/07/2029  | 523 138          | 0,12              | 1 280 000 2.625% Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 28/04/2025                                       | 1 164 493        | 0,27              |
| 1 390 000 4.250% Altice France SA/France 15/10/2029  | 1 043 474        | 0,24              | 1 080 000 1.875% Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 09/01/2026                                       | 926 046          | 0,21              |
| 500 000 1.125% Amplifon SpA 13/02/2027   | 440 035          | 0,10              | 810 000 2.375% Banca Popolare di Sondrio SPA 03/04/2024   | 793 986          | 0,18              |
| 1 440 000 6.000% ams-OSRAM AG 31/07/2025   | 1 339 114        | 0,31              | 800 000 2.500% Banco BPM SpA 21/06/2024   | 782 312          | 0,18              |
| 550 000 4.625% APCOA Parking Holdings GmbH 15/01/2027  | 468 820          | 0,11              | 865 000 1.750% Banco BPM SpA 28/01/2025   | 820 980          | 0,19              |
|  |                  |                   | 1 150 000 1.625% Banco BPM SpA 18/02/2025   | 1 079 160        | 0,25              |

## SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 97,81 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Euro – 97,81 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 795 000 0.875% Banco BPM SpA 15/07/2026                                 | 706 787          | 0,16              | 2 100 000 2.000% Cellnex Finance Co SA 15/02/2023                       | 1 612 779        | 0,37              |
| 880 000 6.000% Banco BPM SpA 13/09/2026                                 | 903 285          | 0,21              | 800 000 2.875% Cellnex Telecom SA 18/04/2025                            | 782 976          | 0,18              |
| 1 300 000 4.875% Banco BPM SpA 18/01/2027                               | 1 282 541        | 0,30              | 600 000 1.000% Cellnex Telecom SA 20/04/2027                            | 525 768          | 0,12              |
| 1 800 000 1.750% Banco de Sabadell SA 10/05/2024                        | 1 740 420        | 0,40              | 1 100 000 1.875% Cellnex Telecom SA 26/06/2029                          | 919 171          | 0,21              |
| 800 000 1.125% Banco de Sabadell SA 27/03/2025                          | 736 800          | 0,17              | 1 700 000 1.750% Cellnex Telecom SA 23/10/2030                          | 1 359 405        | 0,31              |
| 966 000 3.500% Banijay Entertainment SASU 01/03/2025                    | 939 078          | 0,22              | 1 078 000 5.875% Centurion Bidco SpA 30/09/2026                         | 962 953          | 0,22              |
| 650 000 6.500% Banijay Group SAS 01/03/2026                             | 636 025          | 0,15              | 970 000 7.750% CGG SA 01/04/2027  | 821 299          | 0,19              |
| 1 250 000 4.750% BCP V Modular Services Finance II PLC 30/11/2028       | 1 062 950        | 0,25              | 795 000 4.000% Chemours Co 15/05/2026                                   | 731 599          | 0,17              |
| 750 000 6.750% BCP V Modular Services Finance PLC 30/11/2029            | 596 738          | 0,14              | 920 000 3.500% Cheplapharm Arzneimittel GmbH 11/02/2027                 | 848 525          | 0,20              |
| 500 000 5.750% Bilfinger SE 14/06/2024                                  | 495 940          | 0,11              | 855 000 4.375% Cheplapharm Arzneimittel GmbH 15/01/2028                 | 794 269          | 0,18              |
| 655 000 5.250% BK LC Lux Finco1 Sarl 30/04/2029                         | 580 559          | 0,13              | 1 235 000 3.500% Chrome Bidco SASU 31/05/2028                           | 1 024 494        | 0,24              |
| 610 000 6.500% Boxer Parent Co Inc 02/10/2025                           | 604 071          | 0,14              | 1 150 000 5.000% Cidron Aida Finco Sarl 01/04/2028                      | 1 013 173        | 0,23              |
| 730 000 1.875% BPER Banca 07/07/2025                                    | 688 697          | 0,16              | 360 000 4.750% Cirs Finance International Sarl 22/05/2025               | 347 634          | 0,08              |
| 1 870 000 3.375% CAB SELAS 01/02/2028                                   | 1 533 849        | 0,35              | 1 030 000 4.500% Cirs Finance International Sarl 15/03/2027             | 898 304          | 0,21              |
| 550 000 1.750% Canary Wharf Group Investment Holdings PLC 07/04/2026    | 434 181          | 0,10              | 920 000 10.375% Cirs Finance International Sarl 30/11/2027              | 974 105          | 0,22              |
| 725 000 10.125% Carnival Corp 01/02/2026                                | 761 946          | 0,18              | 1 220 000 4.375% Clarios Global LP / Clarios US Finance Co 15/05/2026   | 1 164 063        | 0,27              |
| 850 000 7.625% Carnival Corp 01/03/2026                                 | 757 656          | 0,17              | 565 000 5.750% Compact Bidco BV 01/05/2026                              | 410 535          | 0,09              |
| 1 010 000 1.000% Carnival PLC 28/10/2029                                | 515 308          | 0,12              | 400 000 5.000% Consolidated Energy Finance SA 15/10/2028                | 348 232          | 0,08              |
| 300 000 3.580% Casino Guichard Perrachon SA 07/02/2025                  | 91 548           | 0,02              | 587 000 4.250% Constellium SE 15/02/2026                                | 571 761          | 0,13              |
| 650 000 6.625% Casino Guichard Perrachon SA 15/01/2026                  | 196 495          | 0,05              | 500 000 3.125% Constellium SE 15/07/2029                                | 405 140          | 0,09              |
| 700 000 4.048% Casino Guichard Perrachon SA 05/08/2026                  | 178 514          | 0,04              | 670 000 2.750% ContourGlobal Power Holdings SA 01/01/2026               | 602 922          | 0,14              |
| 575 000 5.250% Casino Guichard Perrachon SA 15/04/2027                  | 168 418          | 0,04              | 690 000 3.125% ContourGlobal Power Holdings SA 01/01/2028               | 550 456          | 0,13              |
| 620 000 6.000% Castor SpA 15/02/2029                                    | 550 120          | 0,13              | 1 260 000 3.875% Coty Inc 15/04/2026                                    | 1 210 217        | 0,28              |
| 1 390 000 2.375% Catalent Pharma Solutions Inc 01/03/2028               | 1 248 470        | 0,29              | 880 000 2.625% Crown European Holdings SA 30/09/2024                    | 860 015          | 0,20              |
| 800 000 1.750% CECONOMY AG 24/06/2026                                   | 552 160          | 0,13              | 1 145 000 3.375% Crown European Holdings SA 15/05/2025                  | 1 125 638        | 0,26              |
| 1 800 000 2.250% Cellnex Finance Co SA 12/04/2026                       | 1 693 404        | 0,39              | 800 000 2.875% Crown European Holdings SA 01/02/2026                    | 765 432          | 0,18              |
| 1 000 000 0.750% Cellnex Finance Co SA 15/11/2026                       | 882 800          | 0,20              | 770 000 5.500% CT Investment GmbH 15/04/2026                            | 676 376          | 0,16              |
| 1 600 000 1.000% Cellnex Finance Co SA 15/09/2027                       | 1 364 912        | 0,32              | 820 000 5.250% Ctec II GmbH 15/02/2030                                  | 682 871          | 0,16              |
| 1 800 000 1.500% Cellnex Finance Co SA 08/06/2028                       | 1 535 472        | 0,35              | 630 000 4.625% Cullinan Holdco Scsp 15/10/2026                          | 554 589          | 0,13              |
| 1 400 000 1.250% Cellnex Finance Co SA 15/01/2029                       | 1 145 760        | 0,26              | 600 000 3.000% Dana Financing Luxembourg Sarl 15/07/2029                | 463 764          | 0,11              |
| 1 400 000 2.000% Cellnex Finance Co SA 05/09/2032                       | 1 085 182        | 0,25              | 770 000 3.625% Darling Global Finance BV 15/05/2026                     | 747 508          | 0,17              |
|   |                  |                   | 900 000 1.875% DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate AG 15/10/2024    | 623 160          | 0,14              |

## SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b>                       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b>                 |                  |                   |
| <b>Euro – 97,81 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Euro – 97,81 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 385 000 2.250% Derichebourg SA 15/07/2028                               | 334 758          | 0,08              | 600 000 4.000% Energia Group NI FinanceCo PLC/Energia Group ROI Holdings DAC 15/09/2025 | 570 498          | 0,13              |
| 700 000 2.000% Deutsche Lufthansa AG 14/07/2024                         | 677 495          | 0,16              | 1 045 000 3.500% Energizer Gamma Acquisition BV 30/06/2029                              | 837 296          | 0,19              |
| 450 000 0.250% Deutsche Lufthansa AG 06/09/2024                         | 430 025          | 0,10              | 700 000 4.875% Eolo SpA 21/10/2028  | 550 515          | 0,13              |
| 1 500 000 2.875% Deutsche Lufthansa AG 11/02/2025                       | 1 444 185        | 0,33              | 800 000 1.875% Esselunga SpA 25/10/2027   | 730 520          | 0,17              |
| 1 800 000 3.000% Deutsche Lufthansa AG 29/05/2026                       | 1 675 152        | 0,39              | 450 000 3.375% Explorer II AS 24/02/2025  | 407 889          | 0,09              |
| 1 500 000 2.875% Deutsche Lufthansa AG 16/05/2027                       | 1 353 360        | 0,31              | 925 000 1.875% Fastighets AB Balder 14/03/2025  | 821 382          | 0,19              |
| 1 600 000 3.750% Deutsche Lufthansa AG 11/02/2028                       | 1 458 944        | 0,34              | 925 000 1.875% Fastighets AB Balder 23/01/2026  | 779 692          | 0,18              |
| 900 000 3.500% Deutsche Lufthansa AG 14/07/2029                         | 789 795          | 0,18              | 1 664 000 2.625% Faurecia SE 15/06/2025   | 1 592 099        | 0,37              |
| 700 000 2.250% DIC Asset AG 22/09/2026                                  | 443 807          | 0,10              | 1 270 000 3.125% Faurecia SE 15/06/2026   | 1 191 071        | 0,27              |
| 600 000 9.000% Diebold Nixdorf Dutch Holding BV 15/07/2025              | 301 780          | 0,07              | 1 610 000 7.250% Faurecia SE 15/06/2026   | 1 660 184        | 0,38              |
| 520 000 3.000% Dometic Group AB 08/05/2026                              | 472 285          | 0,11              | 2 130 000 2.750% Faurecia SE 15/02/2027   | 1 891 533        | 0,44              |
| 500 000 2.000% Dometic Group AB 29/09/2028                              | 382 435          | 0,09              | 1 421 000 2.375% Faurecia SE 15/06/2027   | 1 237 904        | 0,29              |
| 2 210 000 6.000% Douglas GmbH 08/04/2026                                | 1 948 132        | 0,45              | 1 300 000 3.750% Faurecia SE 15/06/2028   | 1 164 633        | 0,27              |
| 450 000 5.000% doValue SpA 04/08/2025                                   | 433 998          | 0,10              | 480 000 2.375% Faurecia SE 15/06/2029   | 389 645          | 0,09              |
| 450 000 3.375% doValue SpA 31/07/2026                                   | 393 485          | 0,09              | 580 000 11.000% Fiber Bidco Spa 25/10/2027  | 623 169          | 0,14              |
| 400 000 2.625% Drax Finco PLC 01/11/2025                                | 378 956          | 0,09              | 560 000 5.625% FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 01/08/2027                           | 495 846          | 0,11              |
| 1 038 000 2.500% Dufry One BV 15/10/2024                                | 1 019 513        | 0,24              | 410 000 5.000% Flamingo Lux II SCA 31/03/2029   | 300 690          | 0,07              |
| 1 538 000 2.000% Dufry One BV 15/02/2027                                | 1 326 164        | 0,31              | 480 000 1.875% Fnac Darty SA 30/05/2024   | 462 787          | 0,11              |
| 1 250 000 3.375% Dufry One BV 15/04/2028                                | 1 098 437        | 0,25              | 450 000 2.625% Fnac Darty SA 30/05/2026   | 420 264          | 0,10              |
| 845 000 3.000% EC Finance PLC 15/10/2026                                | 777 991          | 0,18              | 1 365 000 1.744% Ford Motor Credit Co LLC 19/07/2024                                    | 1 310 318        | 0,30              |
| 700 000 5.500% eDreams ODIGEO SA 15/07/2027                             | 603 869          | 0,14              | 790 000 1.355% Ford Motor Credit Co LLC 07/02/2025                                      | 740 902          | 0,17              |
| 1 382 000 4.375% eG Global Finance PLC 07/02/2025                       | 1 262 802        | 0,29              | 1 550 000 3.250% Ford Motor Credit Co LLC 15/09/2025                                    | 1 484 202        | 0,34              |
| 1 101 000 6.250% eG Global Finance PLC 30/10/2025                       | 1 016 245        | 0,23              | 965 000 2.330% Ford Motor Credit Co LLC 25/11/2025                                      | 897 797          | 0,21              |
| 260 000 1.750% eircom Finance DAC 01/11/2024                            | 255 424          | 0,06              | 1 303 000 2.386% Ford Motor Credit Co LLC 17/02/2026                                    | 1 213 341        | 0,28              |
| 1 350 000 3.500% eircom Finance DAC 15/05/2026                          | 1 278 855        | 0,30              | 1 500 000 4.867% Ford Motor Credit Co LLC 03/08/2027                                    | 1 455 885        | 0,34              |
| 600 000 2.625% eircom Finance DAC 15/02/2027                            | 537 150          | 0,12              | 670 000 8.125% Gamma Bondco Sarl 15/11/2026   | 648 580          | 0,15              |
| 1 005 000 3.750% Elior Group SA 15/07/2026                              | 879 259          | 0,20              | 1 280 000 6.750% Garfunkelux Holdco 3 SA 01/11/2025                                     | 979 558          | 0,23              |
| 500 000 1.750% Elis SA 11/04/2024                                       | 488 740          | 0,11              | 680 000 3.250% Gestamp Automocion SA 30/04/2026   | 646 061          | 0,15              |
| 1 100 000 1.000% Elis SA 03/04/2025                                     | 1 036 585        | 0,24              | 1 400 000 3.500% Getlink SE 30/10/2025  | 1 356 726        | 0,31              |
| 700 000 2.875% Elis SA 15/02/2026                                       | 678 500          | 0,16              | 650 000 5.375% Goldstory SASU 01/03/2026  | 595 953          | 0,14              |
| 500 000 4.125% Elis SA 24/05/2027                                       | 497 870          | 0,12              | 625 000 2.750% Goodyear Europe BV 15/08/2028  | 508 125          | 0,12              |
| 1 000 000 1.625% Elis SA 03/04/2028                                     | 884 860          | 0,20              | 480 000 2.625% Graphic Packaging International LLC 01/02/2029                           | 414 686          | 0,10              |
| 715 000 3.375% Emerica SASU 31/03/2028                                  | 565 279          | 0,13              | 2 200 000 3.875% Grifols Escrow Issuer SA 15/10/2028                                    | 1 715 252        | 0,40              |
| 670 000 7.750% Emerica SASU 31/03/2028                                  | 635 314          | 0,15              | 1 435 000 1.625% Grifols SA 15/02/2025  | 1 350 981        | 0,31              |
| 810 000 4.875% Encore Capital Group Inc 15/10/2025                      | 736 071          | 0,17              |   |                  |                   |



## SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b>        |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Euro – 97,81 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Euro – 97,81 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 1 677 000 3.200% Grifols SA 01/05/2025                                  | 1 526 892        | 0,35              | 1 570 000 2.500% INEOS Quattro Finance 2 Plc 15/01/2026                  | 1 403 015        | 0,32              |
| 1 360 000 2.250% Grifols SA 15/11/2027                                  | 1 153 253        | 0,27              | 890 000 2.250% INEOS Styrolution Group GmbH 16/01/2027                   | 770 366          | 0,18              |
| 729 000 3.625% Gruenthal GmbH 15/11/2026                                | 684 487          | 0,16              | 1 613 000 1.875% Infrastrutture Wireless Italiane SpA 08/07/2026         | 1 519 672        | 0,35              |
| 880 000 4.125% Gruenthal GmbH 15/05/2028                                | 798 600          | 0,18              | 1 291 000 1.625% Infrastrutture Wireless Italiane SpA 21/10/2028         | 1 146 808        | 0,26              |
| 350 000 3.375% Grupo Antolin-Irausa SA 30/04/2026                       | 292 821          | 0,07              | 852 000 1.750% Infrastrutture Wireless Italiane SpA 19/04/2031           | 728 741          | 0,17              |
| 680 000 3.500% Grupo Antolin-Irausa SA 30/04/2028                       | 493 186          | 0,11              | 740 000 6.750% Inter Media and Communication SpA 09/02/2027              | 694 024          | 0,16              |
| 820 000 3.250% Guala Closures SpA 15/06/2028                            | 703 404          | 0,16              | 800 000 2.750% International Consolidated Airlines Group SA 25/03/2025   | 764 184          | 0,17              |
| 345 000 2.500% Hapag-Lloyd AG 15/04/2028                                | 315 195          | 0,07              | 800 000 1.500% International Consolidated Airlines Group SA 04/07/2027   | 657 432          | 0,15              |
| 600 000 4.250% Heimstaden AB 09/03/2026                                 | 421 130          | 0,10              | 1 200 000 3.750% International Consolidated Airlines Group SA 25/03/2029 | 996 072          | 0,23              |
| 800 000 4.375% Heimstaden AB 06/03/2027                                 | 556 480          | 0,13              | 740 000 6.500% International Design Group SPA 15/11/2025                 | 714 756          | 0,17              |
| 775 000 5.250% Herens Midco Sarl 15/05/2029                             | 515 158          | 0,12              | 75 230 3.500% International Game Technology PLC 15/07/2024               | 74 705           | 0,02              |
| 400 000 3.250% Hornbach Baumarkt AG 25/10/2026                          | 381 204          | 0,09              | 1 405 000 3.500% International Game Technology PLC 15/06/2026            | 1 354 996        | 0,31              |
| 550 000 5.625% HSE Finance Sarl 15/10/2026                              | 271 530          | 0,06              | 850 000 2.375% International Game Technology PLC 15/04/2028              | 748 144          | 0,17              |
| 780 000 9.250% HT Troplast GmbH 15/07/2025                              | 768 768          | 0,18              | 580 000 9.750% International Personal Finance PLC 12/11/2025             | 512 830          | 0,12              |
| 800 000 4.250% Huhtamaki Oyj 09/06/2027                                 | 780 664          | 0,18              | 674 000 5.250% Intralot Capital Luxembourg SA 15/09/2024                 | 626 622          | 0,14              |
| 580 000 6.375% Ideal Standard International SA 30/07/2026               | 319 232          | 0,07              | 611 785 3.125% Intrum AB 15/07/2024                                      | 585 814          | 0,14              |
| 1 480 000 3.625% IHO Verwaltungs GmbH 15/05/2025                        | 1 475 116        | 0,34              | 1 445 000 4.875% Intrum AB 15/08/2025                                    | 1 332 420        | 0,31              |
| 1 570 000 3.750% IHO Verwaltungs GmbH 15/09/2026                        | 1 411 446        | 0,33              | 1 510 000 3.500% Intrum AB 15/07/2026                                    | 1 260 080        | 0,29              |
| 517 515 3.875% IHO Verwaltungs GmbH 15/05/2027                          | 454 761          | 0,11              | 1 360 000 3.000% Intrum AB 15/09/2027                                    | 1 057 917        | 0,24              |
| 825 000 8.750% IHO Verwaltungs GmbH 15/05/2028                          | 845 790          | 0,20              | 790 000 9.250% Intrum AB 15/03/2028                                      | 774 579          | 0,18              |
| 1 850 000 5.125% Iliad Holding SASU 15/10/2026                          | 1 778 978        | 0,41              | 772 000 5.500% IPD 3 BV 01/12/2025                                       | 756 730          | 0,17              |
| 1 300 000 5.625% Iliad Holding SASU 15/10/2028                          | 1 211 118        | 0,28              | 650 000 2.875% IQVIA Inc 15/09/2025                                      | 637 215          | 0,15              |
| 1 400 000 1.875% Iliad SA 25/04/2025                                    | 1 323 280        | 0,31              | 814 000 1.750% IQVIA Inc 15/03/2026                                      | 758 046          | 0,18              |
| 1 100 000 2.375% Iliad SA 17/06/2026                                    | 1 007 391        | 0,23              | 1 278 000 2.250% IQVIA Inc 15/01/2028                                    | 1 131 196        | 0,26              |
| 1 200 000 5.375% Iliad SA 14/06/2027                                    | 1 193 040        | 0,28              | 1 280 000 2.875% IQVIA Inc 15/06/2028                                    | 1 148 582        | 0,27              |
| 1 000 000 1.875% Iliad SA 11/02/2028                                    | 838 820          | 0,19              | 1 425 000 2.250% IQVIA Inc 15/03/2029                                    | 1 213 993        | 0,28              |
| 700 000 5.625% Iliad SA 15/02/2030                                      | 681 044          | 0,16              | 500 000 10.000% Italmatch Chemicals SpA 06/02/2028                       | 510 165          | 0,12              |
| 500 000 6.625% Illimity Bank SpA 09/12/2025                             | 491 775          | 0,11              | 830 000 5.875% Jaguar Land Rover Automotive PLC 15/11/2024               | 813 450          | 0,19              |
| 400 000 8.000% IM Group SAS 01/03/2028                                  | 390 060          | 0,09              | 860 000 4.500% Jaguar Land Rover Automotive PLC 15/01/2026               | 797 960          | 0,18              |
| 1 275 000 3.750% IMA Industria Macchine Automatiche SpA 15/01/2028      | 1 118 481        | 0,26              | 810 000 6.875% Jaguar Land Rover Automotive PLC 15/11/2026               | 774 575          | 0,18              |
| 662 000 2.125% Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ SpA 28/11/2024     | 595 800          | 0,14              |  |                  |                   |
| 942 000 2.125% INEOS Finance PLC 15/11/2025                             | 885 037          | 0,20              |  |                  |                   |
| 620 000 3.375% INEOS Finance PLC 31/03/2026                             | 580 704          | 0,13              |  |                  |                   |
| 1 222 000 2.875% INEOS Finance PLC 01/05/2026                           | 1 139 368        | 0,26              |  |                  |                   |
| 650 000 6.625% INEOS Finance PLC 15/05/2028                             | 655 519          | 0,15              |  |                  |                   |
| 906 000 3.750% INEOS Quattro Finance 1 Plc 15/07/2026                   | 785 357          | 0,18              |  |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b>         |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b>   |                  |                   |
| <b>Euro – 97,81 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Euro – 97,81 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 870 000 4.500% Jaguar Land Rover Automotive PLC 15/07/2028              | 715 079          | 0,17              | 521 875 7.775% Mangrove Luxco III Sarl 09/10/2025                         | 291 405          | 0,07              |
| 785 000 3.625% James Hardie International Finance DAC 01/10/2026        | 741 613          | 0,17              | 550 000 6.125% Marcolin SpA 15/11/2026                                    | 459 949          | 0,11              |
| 300 000 3.250% K+S AG 18/07/2024  | 297 822          | 0,07              | 500 000 2.625% Matterhorn Telecom SA 15/09/2024                           | 494 930          | 0,11              |
| 800 000 5.125% Kaixo Bondco Telecom SA 30/09/2029                       | 700 568          | 0,16              | 1 000 000 3.125% Matterhorn Telecom SA 15/09/2026                         | 925 760          | 0,21              |
| 490 000 5.000% Kane Bidco Ltd 15/02/2027                                | 451 854          | 0,10              | 685 000 4.000% Matterhorn Telecom SA 15/11/2027                           | 631 913          | 0,15              |
| 800 000 3.375% Kapla Holding SAS 15/12/2026                             | 702 424          | 0,16              | 848 000 5.875% Maxeda DIY Holding BV 01/10/2026                           | 635 966          | 0,15              |
| 755 000 4.250% Kleopatra Finco Sarl 01/03/2026                          | 627 798          | 0,14              | 840 000 4.250% Mobilux Finance SAS 15/07/2028                             | 694 764          | 0,16              |
| 500 000 6.500% Kleopatra Holdings 2 SCA 01/09/2026                      | 291 995          | 0,07              | 545 000 5.250% Monitchem HoldCo 3 SA 15/03/2025                           | 543 207          | 0,13              |
| 650 000 3.750% Kronos International Inc 15/09/2025                      | 592 423          | 0,14              | 500 000 4.500% Motion Bondco DAC 15/11/2027                               | 441 665          | 0,10              |
| 978 000 4.000% La Financiere Atalian SASU 15/05/2024                    | 718 996          | 0,17              | 931 000 7.000% Motion Finco Sarl 15/05/2025                               | 942 032          | 0,22              |
| 595 000 5.125% La Financiere Atalian SASU 15/05/2025                    | 402 483          | 0,09              | 802 000 3.325% MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 24/03/2025 | 665 323          | 0,15              |
| 470 000 5.000% Laboratoire Eimer Selas 01/02/2029                       | 351 739          | 0,08              | 860 000 0.993% MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 15/10/2026 | 581 386          | 0,13              |
| 723 000 1.500% Leonardo SpA 07/06/2024                                  | 701 303          | 0,16              | 895 000 2.500% Mytilineos Financial Partners SA 01/12/2024                | 868 132          | 0,20              |
| 790 000 4.875% Leonardo SpA 24/03/2025                                  | 800 910          | 0,18              | 610 000 2.250% Mytilineos SA 30/10/2026                                   | 560 987          | 0,13              |
| 869 000 2.375% Leonardo SpA 08/01/2026                                  | 832 632          | 0,19              | 700 000 5.500% Nexans SA 05/04/2028                                       | 717 430          | 0,17              |
| 818 000 3.375% Levi Strauss & Co 15/03/2027                             | 763 897          | 0,18              | 720 000 1.750% Nexi SpA 31/10/2024  | 700 243          | 0,16              |
| 919 261 7.250% LHMC Finco 2 Sarl 02/10/2025                             | 844 562          | 0,20              | 1 580 000 1.625% Nexi SpA 30/04/2026                                      | 1 434 087        | 0,33              |
| 570 000 5.000% Libra Groupco SpA 15/05/2027                             | 479 364          | 0,11              | 1 570 000 2.125% Nexi SpA 30/04/2029                                      | 1 287 227        | 0,30              |
| 870 761 3.625% Lincoln Financing SARL 01/04/2024                        | 863 890          | 0,20              | 665 000 4.000% NH Hotel Group SA 02/07/2026                               | 624 189          | 0,14              |
| 810 000 6.500% Loarre Investments Sarl 15/05/2029                       | 753 462          | 0,17              | 700 000 3.500% Nidda Healthcare Holding GmbH 30/09/2024                   | 686 140          | 0,16              |
| 3 900 000 4.000% Lorca Telecom Bondco SA 18/09/2027                     | 3 584 685        | 0,83              | 2 330 000 7.500% Nidda Healthcare Holding GmbH 21/08/2026                 | 2 279 336        | 0,53              |
| 970 000 5.125% Lottomatica SpA/Roma 15/07/2025                          | 958 292          | 0,22              | 1 238 000 2.652% Nissan Motor Co Ltd 17/03/2026                           | 1 164 797        | 0,27              |
| 600 000 6.250% Lottomatica SpA/Roma 15/07/2025                          | 597 774          | 0,14              | 1 250 000 3.201% Nissan Motor Co Ltd 17/09/2028                           | 1 123 900        | 0,26              |
| 550 000 9.750% Lottomatica SpA/Roma 30/09/2027                          | 583 506          | 0,13              | 1 040 000 3.125% Nobel Bidco BV 15/06/2028                                | 730 714          | 0,17              |
| 200 000 4.250% Loxam SAS 15/04/2024                                     | 199 580          | 0,05              | 950 000 3.625% Nobian Finance BV 15/07/2026                               | 826 253          | 0,19              |
| 1 379 000 3.250% Loxam SAS 14/01/2025                                   | 1 337 630        | 0,31              | 1 249 000 2.500% Nomad Foods Bondco PLC 24/06/2028                        | 1 090 489        | 0,25              |
| 500 000 2.875% Loxam SAS 15/04/2026                                     | 455 210          | 0,11              | 570 000 5.000% Novafives SAS 15/06/2025                                   | 499 115          | 0,12              |
| 940 000 3.750% Loxam SAS 15/07/2026                                     | 871 521          | 0,20              | 830 000 3.375% Novelis Sheet Ingot GmbH 15/04/2029                        | 722 141          | 0,17              |
| 620 000 4.500% Loxam SAS 15/02/2027                                     | 583 708          | 0,13              | 1 290 000 3.125% OI European Group BV 15/11/2024                          | 1 260 730        | 0,29              |
| 600 000 7.250% LSF XI Magpie Bidco Sarl 30/06/2027                      | 546 660          | 0,13              | 938 000 2.875% OI European Group BV 15/02/2025                            | 912 989          | 0,21              |
| 860 000 5.625% Lune Holdings Sarl 15/11/2028                            | 728 712          | 0,17              | 750 000 3.875% Olympus Water US Holding Corp 01/10/2028                   | 609 143          | 0,14              |
| 1 200 000 2.375% Mahle GmbH 14/05/2028                                  | 914 820          | 0,21              | 500 000 5.375% Olympus Water US Holding Corp 01/10/2029                   | 366 135          | 0,08              |

## SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets  | Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|--|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b>       |                  |  | <b>Valeurs mobilières – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b> |                  |  | <b>Obligations d'entreprise – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 97,81 % (suite)</b>   |                  |  | <b>Euro – 97,81 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 1 040 000   | 3.500%           | Ontex Group NV 15/07/2026                                    | 910 260   | 0,21             |                   |
| 2 014 000   | 2.875%           | Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 30/04/2028  | 1 771 071   | 0,41             |                   |
| 910 000   | 4.000%           | Paprec Holding SA 31/03/2025                                 | 894 785   | 0,21             |                   |
| 800 000   | 3.500%           | Paprec Holding SA 01/07/2028                                 | 696 208   | 0,16             |                   |
| 1 030 000   | 6.500%           | Parts Europe SA 16/07/2025                                   | 1 034 305   | 0,24             |                   |
| 550 000   | 3.000%           | Paysafe Finance PLC / Paysafe Holdings US Corp 15/06/2029    | 428 973   | 0,10             |                   |
| 640 000   | 4.750%           | PCF GmbH 15/04/2026  | 554 029   | 0,13             |                   |
| 530 000   | 4.375%           | Peach Property Finance GmbH 15/11/2025                       | 426 120   | 0,10             |                   |
| 530 000   | 5.750%           | PeopleCert Wisdom Issuer PLC 15/09/2026                      | 502 610   | 0,12             |                   |
| 600 000   | 4.750%           | PHM Group Holding Oy 18/06/2026                              | 544 810   | 0,13             |                   |
| 600 000   | 2.375%           | Phoenix PIB Dutch Finance BV 05/08/2025                      | 568 872   | 0,13             |                   |
| 500 000   | 3.625%           | Piaggio & C SpA 30/04/2025                                   | 491 144   | 0,11             |                   |
| 550 000   | 5.375%           | Picard Bondco SA 01/07/2027                                  | 464 041   | 0,11             |                   |
| 1 250 000   | 3.875%           | Picard Groupe SAS 01/07/2026                                 | 1 115 262   | 0,26             |                   |
| 1 045 000   | 5.500%           | Pinnacle Bidco PLC 15/02/2025                                | 965 381   | 0,22             |                   |
| 460 000   | 4.250%           | Playtech Plc 07/03/2026                                      | 442 414   | 0,10             |                   |
| 840 000   | 4.625%           | PLT VII Finance Sarl 05/01/2026                              | 785 980   | 0,18             |                   |
| 900 000   | 3.500%           | PPF Telecom Group BV 20/05/2024                              | 886 122   | 0,20             |                   |
| 1 269 000   | 2.125%           | PPF Telecom Group BV 31/01/2025                              | 1 199 015   | 0,28             |                   |
| 860 000   | 3.125%           | PPF Telecom Group BV 27/03/2026                              | 806 250   | 0,19             |                   |
| 902 000   | 3.250%           | PPF Telecom Group BV 29/09/2027                              | 825 330   | 0,19             |                   |
| 550 000   | 12.000%          | Preem Holdings AB 30/06/2027                                 | 587 131   | 0,14             |                   |
| 710 000   | 3.875%           | Primo Water Holdings Inc 31/10/2028                          | 616 671   | 0,14             |                   |
| 400 000   | 3.250%           | Pro-Gest SpA 15/12/2024                                      | 300 592   | 0,07             |                   |
| 965 000   | 3.000%           | ProGroup AG 31/03/2026                                       | 897 508   | 0,21             |                   |
| 590 000   | 6.375%           | Promontoria Holding 264 BV 01/03/2027                        | 567 332   | 0,13             |                   |
| 700 000   | 1.500%           | Q-Park Holding I BV 01/03/2025                               | 643 622   | 0,15             |                   |
| 1 050 000   | 2.000%           | Q-Park Holding I BV 01/03/2027                               | 872 539   | 0,20             |                   |
| 790 000   | 7.250%           | Rekeep SpA 01/02/2026  | 695 192   | 0,16             |                   |
| 800 000   | 1.000%           | Renault SA 18/04/2024  | 771 880   | 0,18             |                   |
| 1 900 000   | 1.250%           | Renault SA 24/06/2025  | 1 754 118   | 0,40             |                   |
| 1 051 000   | 1.000%           | Renault SA 28/11/2025  | 969 285   | 0,22             |                   |
| 1 900 000   | 2.375%           | Renault SA 25/05/2026  | 1 737 797   | 0,40             |                   |
| 1 200 000   | 2.000%           | Renault SA 28/09/2026  | 1 069 212   | 0,25             |                   |
| 1 100 000   | 2.500%           | Renault SA 02/06/2027  | 971 212   | 0,22             |                   |
| 600 000   | 1.125%           | Renault SA 04/10/2027  | 489 456   | 0,11             |                   |
| 1 000 000   | 2.500%           | Renault SA 01/04/2028  | 854 010   | 0,20             |                   |
| 920 000   | 5.750%           | Renk AG/Frankfurt am Main 15/07/2025                         | 900 315   | 0,21             |                   |
| 660 000   | 2.125%           | Rexel SA 15/06/2028  | 579 407   | 0,13             |                   |
| 990 000   | 2.125%           | Rexel SA 15/12/2028  | 859 330   | 0,20             |                   |
| 879 000   | 0.875%           | Rolls-Royce PLC 09/05/2024                                   | 844 772   | 0,20             |                   |
| 1 285 000   | 4.625%           | Rolls-Royce PLC 16/02/2026                                   | 1 272 127   | 0,29             |                   |
| 1 010 000   | 1.625%           | Rolls-Royce PLC 09/05/2028                                   | 838 277   | 0,19             |                   |
| 1 151 000   | 6.750%           | Rossini Sarl 30/10/2025                                      | 1 153 302   | 0,27             |                   |
| 822 000   | 2.625%           | Saipem Finance International BV 07/01/2025                   | 781 854   | 0,18             |                   |
| 880 000   | 3.375%           | Saipem Finance International BV 15/07/2026                   | 810 145   | 0,19             |                   |
| 910 000   | 3.125%           | Saipem Finance International BV 31/03/2028                   | 793 493   | 0,18             |                   |
| 565 000   | 3.500%           | Samsonite Finco Sarl 15/05/2026                              | 514 014   | 0,12             |                   |
| 490 000   | 1.800%           | Samvardhana Motherson Automotive Systems Group BV 06/07/2024 | 467 097   | 0,11             |                   |
| 450 000   | 5.625%           | Sani/lkos Financial Holdings 1 Sarl 15/12/2026               | 416 903   | 0,10             |                   |
| 400 000   | 5.750%           | Sarens Finance Co NV 21/02/2027                              | 316 844   | 0,07             |                   |
| 1 500 000   | 2.750%           | Schaeffler AG 12/10/2025                                     | 1 452 615   | 0,34             |                   |
| 1 120 000   | 2.875%           | Schaeffler AG 26/03/2027                                     | 1 076 544   | 0,25             |                   |
| 1 300 000   | 3.375%           | Schaeffler AG 12/10/2028                                     | 1 190 618   | 0,27             |                   |
| 340 000   | 6.375%           | Schoeller Packaging BV 01/11/2024                            | 241 376   | 0,06             |                   |
| 860 000   | 4.375%           | SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC 01/11/2026               | 792 172   | 0,18             |                   |
| 520 000   | 2.250%           | Seche Environnement SA 15/11/2028                            | 442 926   | 0,10             |                   |
| 1 383 018   | 8.000%           | Selecta Group BV 01/04/2026                                  | 1 213 446   | 0,28             |                   |
| 502 503   | 10.000%          | Selecta Group BV 01/07/2026                                  | 319 120   | 0,07             |                   |
| 490 000   | 4.625%           | SGL Carbon SE 30/09/2024                                     | 487 931   | 0,11             |                   |
| 490 000   | 7.750%           | SGL International A/S 08/04/2025                             | 496 698   | 0,11             |                   |
| 630 000   | 4.500%           | Sherwood Financing PLC 15/11/2026                            | 540 181   | 0,12             |                   |
| 825 000   | 4.500%           | Shiba Bidco SpA 31/10/2028                                   | 665 775   | 0,15             |                   |
| 950 000   | 2.125%           | SIG Combibloc PurchaseCo Sarl 18/06/2025                     | 913 928   | 0,21             |                   |
| 600 000   | 5.250%           | SIG PLC 30/11/2026   | 511 332   | 0,12             |                   |
| 1 190 000   | 5.750%           | Sigma Holdco BV 15/05/2026                                   | 949 595   | 0,22             |                   |
| 300 000   | 5.500%           | Sigma Development Finance SCS 23/07/2026                     | 178 131   | 0,04             |                   |
| 1 306 000   | 3.250%           | Silgan Holdings Inc 15/03/2025                               | 1 269 105   | 0,29             |                   |
| 847 000   | 2.250%           | Silgan Holdings Inc 01/06/2028                               | 713 919   | 0,16             |                   |

## SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 97,81 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Euro – 97,81 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 930 000 2.125% SoftBank Group Corp 06/07/2024                           | 880 598          | 0,20              | 1 865 000 2.375% Telecom Italia SpA/Milano 12/10/2027                   | 1 607 667        | 0,37              |
| 450 000 4.500% SoftBank Group Corp 20/04/2025                           | 433 524          | 0,10              | 1 810 000 6.875% Telecom Italia SpA/Milano 15/02/2028                   | 1 847 016        | 0,43              |
| 750 000 4.750% SoftBank Group Corp 30/07/2025                           | 716 760          | 0,17              | 1 690 000 1.625% Telecom Italia SpA/Milano 18/01/2029                   | 1 320 008        | 0,30              |
| 1 143 000 3.125% SoftBank Group Corp 19/09/2025                         | 1 045 845        | 0,24              | 800 000 3.500% Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 01/03/2028         | 729 664          | 0,17              |
| 1 040 000 2.875% SoftBank Group Corp 06/01/2027                         | 886 922          | 0,20              | 290 000 2.000% Teollisuuden Voima Oyj 08/05/2024                        | 282 875          | 0,07              |
| 1 779 000 5.000% SoftBank Group Corp 15/04/2028                         | 1 554 526        | 0,36              | 786 000 2.125% Teollisuuden Voima Oyj 04/02/2025                        | 757 413          | 0,17              |
| 820 000 3.375% SoftBank Group Corp 06/07/2029                           | 630 047          | 0,15              | 1 089 000 1.125% Teollisuuden Voima Oyj 09/03/2026                      | 990 435          | 0,23              |
| 1 010 000 4.000% SoftBank Group Corp 19/09/2029                         | 800 137          | 0,18              | 1 030 000 2.625% Teollisuuden Voima Oyj 31/03/2027                      | 965 996          | 0,22              |
| 930 000 3.875% SoftBank Group Corp 06/07/2032                           | 678 165          | 0,16              | 1 050 000 1.375% Teollisuuden Voima Oyj 23/06/2028                      | 900 973          | 0,21              |
| 500 000 2.000% SPCM SA 01/02/2026                                       | 462 250          | 0,11              | 975 000 7.500% Tereos Finance Groupe I SA 30/10/2025                    | 991 926          | 0,23              |
| 650 000 2.625% SPCM SA 01/02/2029                                       | 563 875          | 0,13              | 225 000 4.750% Tereos Finance Groupe I SA 30/04/2027                    | 207 972          | 0,05              |
| 700 000 4.000% Spectrum Brands Inc 01/10/2026                           | 659 078          | 0,15              | 835 000 7.250% Tereos Finance Groupe I SA 15/04/2028                    | 820 914          | 0,19              |
| 1 000 000 2.625% SPIE SA 18/06/2026                                     | 941 980          | 0,22              | 1 033 000 2.500% thyssenkrupp AG 25/02/2025                             | 1 000 771        | 0,23              |
| 1 389 000 2.250% Standard Industries Inc/NJ 21/11/2026                  | 1 207 257        | 0,28              | 611 000 2.375% Titan Global Finance PLC 16/11/2024                      | 591 589          | 0,14              |
| 500 000 6.250% Standard Profil Automotive GmbH 30/04/2026               | 302 465          | 0,07              | 400 000 2.750% Titan Global Finance PLC 09/07/2027                      | 373 828          | 0,09              |
| 690 000 3.750% Stena International SA 01/02/2025                        | 658 819          | 0,15              | 700 000 5.125% Titan Holdings II BV 15/07/2029                          | 538 615          | 0,12              |
| 500 000 7.250% Stena International SA 15/02/2028                        | 501 905          | 0,12              | 1 026 000 6.625% TK Elevator Holdco GmbH 15/07/2028                     | 867 216          | 0,20              |
| 666 779 9.250% Summer BC Holdco A Sarl 31/10/2027                       | 549 572          | 0,13              | 1 890 000 4.375% TK Elevator Midco GmbH 15/07/2027                      | 1 711 471        | 0,40              |
| 1 860 000 5.750% Summer BC Holdco B SARL 31/10/2026                     | 1 620 655        | 0,37              | 1 350 000 3.750% TMNL Holding BV 15/01/2029                             | 1 177 834        | 0,27              |
| 726 702 9.000% Summer BidCo BV 15/11/2025                               | 560 535          | 0,13              | 1 045 000 3.750% Trivium Packaging Finance BV 15/08/2026                | 964 441          | 0,22              |
| 360 000 2.000% Summit Properties Ltd 31/01/2025                         | 316 908          | 0,07              | 905 000 6.500% TUI Cruises GmbH 15/05/2026                              | 808 762          | 0,19              |
| 851 000 3.875% Synthomer PLC 01/07/2025                                 | 779 550          | 0,18              | 480 000 3.750% UGI International LLC 01/12/2029                         | 373 138          | 0,09              |
| 390 000 3.500% TeamSystem SpA 15/02/2028                                | 344 331          | 0,08              | 1 540 000 3.000% Unipol Gruppo SpA 18/03/2025                           | 1 498 902        | 0,35              |
| 606 646 6.000% Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 30/07/2026        | 574 106          | 0,13              | 900 000 3.500% Unipol Gruppo SpA 29/11/2027                             | 845 586          | 0,20              |
| 1 910 000 2.000% Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 15/07/2025      | 1 779 031        | 0,41              | 1 803 000 3.250% Unipol Gruppo SpA 23/09/2030                           | 1 612 261        | 0,37              |
| 1 150 000 3.875% Tele Columbus AG 02/05/2025                            | 852 298          | 0,20              | 860 000 4.875% United Group BV 01/07/2024                               | 834 879          | 0,19              |
| 1 721 000 7.750% Telecom Italia Finance SA 24/01/2033                   | 1 850 196        | 0,43              | 1 150 000 3.125% United Group BV 15/02/2026                             | 947 692          | 0,22              |
| 2 100 000 4.000% Telecom Italia SpA/Milano 11/04/2024                   | 2 081 520        | 0,48              | 1 000 000 4.000% United Group BV 15/11/2027                             | 735 000          | 0,17              |
| 1 746 000 2.750% Telecom Italia SpA/Milano 15/04/2025                   | 1 665 195        | 0,38              | 930 000 3.625% United Group BV 15/02/2028                               | 662 978          | 0,15              |
| 1 452 000 3.000% Telecom Italia SpA/Milano 30/09/2025                   | 1 378 369        | 0,32              | 430 000 4.625% United Group BV 15/08/2028                               | 317 263          | 0,07              |
| 1 565 000 2.875% Telecom Italia SpA/Milano 28/01/2026                   | 1 461 092        | 0,34              | 810 000 5.250% United Group BV 01/02/2030                               | 576 075          | 0,13              |
| 1 460 000 3.625% Telecom Italia SpA/Milano 25/05/2026                   | 1 396 505        | 0,32              | 500 000 3.875% UPC Holding BV 15/06/2029                                | 415 505          | 0,10              |

## SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR   | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b>       |                    |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 97,81 % (mars 2022 : 98,40 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Euro – 97,81 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Euro – 97,81 % (suite)</b>   |                    |                   |
| 610 000 3.625% UPCB Finance VII Ltd 15/06/2029                          | 530 828          | 0,12              | 655 000 2.250% WMG Acquisition Corp 15/08/2031                          | 520 057            | 0,12              |
| 900 000 1.500% Valeo 18/06/2025   | 847 953          | 0,20              | 915 000 5.500% Wp/ap Telecom Holdings III BV 15/01/2030                 | 760 127            | 0,18              |
| 1 000 000 1.625% Valeo 18/03/2026                                       | 925 084          | 0,21              | 1 500 000 2.000% ZF Europe Finance BV 23/02/2026                        | 1 363 335          | 0,31              |
| 1 500 000 5.375% Valeo 28/05/2027                                       | 1 498 155        | 0,35              | 1 000 000 2.500% ZF Europe Finance BV 23/10/2027                        | 869 820            | 0,20              |
| 1 200 000 1.000% Valeo 03/08/2028                                       | 959 198          | 0,22              | 1 100 000 3.000% ZF Europe Finance BV 23/10/2029                        | 927 860            | 0,21              |
| 1 690 000 8.500% Vallourec SA 30/06/2026                                | 1 681 550        | 0,39              | 1 300 000 3.000% ZF Finance GmbH 21/09/2025                             | 1 234 961          | 0,29              |
| 800 000 1.625% Verallia SA 14/05/2028                                   | 699 896          | 0,16              | 1 200 000 5.750% ZF Finance GmbH 03/08/2026                             | 1 204 560          | 0,28              |
| 800 000 1.875% Verallia SA 10/11/2031                                   | 647 584          | 0,15              | 900 000 2.000% ZF Finance GmbH 06/05/2027                               | 774 801            | 0,18              |
| 900 000 4.625% Verde Bidco SpA 01/10/2026                               | 793 294          | 0,18              | 800 000 2.750% ZF Finance GmbH 25/05/2027                               | 712 040            | 0,16              |
| 1 341 000 3.875% Verisure Holding AB 15/07/2026                         | 1 243 147        | 0,29              | 900 000 2.250% ZF Finance GmbH 03/05/2028                               | 756 153            | 0,17              |
| 1 865 000 3.250% Verisure Holding AB 15/02/2027                         | 1 650 879        | 0,38              | 1 200 000 3.750% ZF Finance GmbH 21/09/2028                             | 1 070 016          | 0,25              |
| 760 000 9.250% Verisure Holding AB 15/10/2027                           | 815 032          | 0,19              | 1 557 000 3.375% Ziggo Bond Co BV 28/02/2030                            | 1 206 093          | 0,28              |
| 834 000 7.125% Verisure Holding AB 01/02/2028                           | 835 050          | 0,19              | 850 000 2.875% Ziggo BV 15/01/2030                                      | 697 630            | 0,16              |
| 1 970 000 5.250% Verisure Midholding AB 15/02/2029                      | 1 632 775        | 0,38              | <b>Total des obligations d'entreprise</b>                               | <b>423 792 706</b> | <b>97,81</b>      |
| 500 000 5.250% Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA 01/04/2026       | 450 195          | 0,10              | <b>Total des valeurs mobilières</b>                                     | <b>423 792 706</b> | <b>97,81</b>      |
| 845 000 3.625% Victoria PLC 26/08/2026                                  | 680 588          | 0,16              |   |                    |                   |
| 390 000 3.750% Victoria PLC 15/03/2028                                  | 304 898          | 0,07              |   |                    |                   |
| 700 000 9.000% Villa Dutch Bidco BV 03/11/2029                          | 660 898          | 0,15              |   |                    |                   |
| 830 000 3.750% Virgin Media Finance PLC 15/07/2030                      | 661 087          | 0,15              |   |                    |                   |
| 1 100 000 3.000% Vivion Investments Sarl 08/08/2024                     | 804 925          | 0,19              |   |                    |                   |
| 1 000 000 3.500% Vivion Investments Sarl 01/11/2025                     | 660 000          | 0,15              |   |                    |                   |
| 1 645 000 3.250% Vmed O2 UK Financing I PLC 31/01/2031                  | 1 338 454        | 0,31              |   |                    |                   |
| 700 000 2.125% Volvo Car AB 02/04/2024                                  | 685 580          | 0,16              |   |                    |                   |
| 735 000 2.000% Volvo Car AB 24/01/2025                                  | 703 924          | 0,16              |   |                    |                   |
| 760 000 2.500% Volvo Car AB 07/10/2027                                  | 680 200          | 0,16              |   |                    |                   |
| 1 120 000 4.250% Volvo Car AB 31/05/2028                                | 1 060 674        | 0,24              |   |                    |                   |
| 1 240 000 3.500% VZ Secured Financing BV 15/01/2032                     | 988 905          | 0,23              |   |                    |                   |
| 1 120 000 2.875% VZ Vendor Financing II BV 15/01/2029                   | 891 766          | 0,21              |   |                    |                   |
| 793 000 1.750% Webuild SpA 26/10/2024                                   | 742 740          | 0,17              |   |                    |                   |
| 1 401 000 5.875% Webuild SpA 15/12/2025                                 | 1 328 078        | 0,31              |   |                    |                   |
| 665 000 3.875% Webuild SpA 28/07/2026                                   | 576 987          | 0,13              |   |                    |                   |
| 230 000 3.625% Webuild SpA 28/01/2027                                   | 195 015          | 0,05              |   |                    |                   |
| 625 000 2.875% WEPA Hygieneprodukte GmbH 15/12/2027                     | 521 200          | 0,12              |   |                    |                   |
| 1 000 000 1.000% Wizz Air Finance Co BV 19/01/2026                      | 868 020          | 0,20              |   |                    |                   |
| 520 000 2.750% WMG Acquisition Corp 15/07/2028                          | 465 234          | 0,11              |   |                    |                   |

|   | Juste valeur EUR   | % du Comp.    |
|---|--------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | 423 792 706        | 97,81         |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 3,58 %)</b>                               | 2 286 034          | 0,53          |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : (1,98 %))</b>                                    | 7 223 212          | 1,66          |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>433 301 952</b> | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

## SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                                   | <b>% du total des actifs</b> |
|--|------------------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs            | 87,28                        |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé                        | 6,97                         |
| Autres valeurs mobilières du type mentionné dans le Règlement 68(1)(a), (b) et (c) | 0,63                         |
| Autres actifs  | 5,12                         |
| <b>Total des actifs</b>  | <b>100,00</b>                |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |             |
|---|-------|----------------------|----------------------|-------------|
| <b>Actifs circulants</b>  |       |                      |                      |             |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :            | 1(e)  |                      |                      |             |
| Valeurs mobilières  |       | 2 600 003 423        | 1 875 277 065        |             |
| Instruments financiers dérivés  |       | 58 745 923           | 36 597 503           |             |
|   |       | <b>2 658 749 346</b> | <b>1 911 874 568</b> |             |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie   | 1(f)  | 41 378 838           | 41 783 159           |             |
| Créances :  |       |                      |                      |             |
| Dividendes à recevoir   |       | 13                   | -                    |             |
| Intérêts à recevoir   |       | 17 709 402           | 11 236 090           |             |
| À recevoir sur cessions d'investissements   |       | 21 263 456           | 16 848 399           |             |
| <b>Total des actifs circulants</b>  |       | <b>2 739 101 055</b> | <b>1 981 742 216</b> |             |
| <b>Passifs circulants</b>   |       |                      |                      |             |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :           | 1(e)  |                      |                      |             |
| Instruments financiers dérivés  |       | (15 971 218)         | (7 384 272)          |             |
| Découverts bancaires  | 1(f)  | (384 790)            | -                    |             |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :  |       |                      |                      |             |
| Charges à payer   |       | (223 213)            | (161 323)            |             |
| Produits divers à payer   |       | (25)                 | -                    |             |
| À payer sur achats d'investissements  |       | (60 129 008)         | (59 140 455)         |             |
| <b>Total des passifs circulants</b>   |       | <b>(76 708 254)</b>  | <b>(66 686 050)</b>  |             |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> |       | <b>2 662 392 801</b> | <b>1 915 056 166</b> |             |
|   |       | <b>2023</b>          | <b>2022</b>          | <b>2021</b> |
| Valeur liquidative par action   |       |                      |                      |             |
| Catégorie couverte en CHF   | 5     | 27,56 CHF            | 29,78 CHF            | 31,35 CHF   |
| Catégorie couverte en EUR   | 5     | 26,49 EUR            | 28,83 EUR            | 30,65 EUR   |
| Catégorie couverte en EUR (Acc)*  | 5     | 30,17 EUR            | -                    | -           |
| Catégorie couverte en GBP   | 5     | 27,77 GBP            | 29,82 GBP            | 31,46 GBP   |
| Catégorie couverte en USD (Acc)   | 5     | 28,15 USD            | 29,39 USD            | 30,60 USD   |
| Catégorie couverte en USD (Dist)  | 5     | 29,40 USD            | 31,14 USD            | 32,83 USD   |
| Catégorie non couverte en USD   | 5     | 25,83 USD            | 28,59 USD            | 30,95 USD   |

\* La catégorie d'actions a été lancée le 9 janvier 2023.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|---|-------|----------------------|----------------------|
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 39 420 934           | 25 946 165           |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 9     | (136 888 577)        | (129 859 927)        |
| Produits divers   |       | 141 055              | -                    |
| <b>Total des charges d'investissement</b>   |       | <b>(97 326 588)</b>  | <b>(103 913 762)</b> |
| Charges opérationnelles   | 3     | (2 013 865)          | (1 976 931)          |
| <b>Perte nette pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(99 340 453)</b>  | <b>(105 890 693)</b> |
| <b>Charges financières</b>  |       |                      |                      |
| Charges d'intérêts  |       | -                    | (65 905)             |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables   | 7     | (27 066 143)         | (21 174 801)         |
| <b>Perte pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(126 406 596)</b> | <b>(127 131 399)</b> |
| Impôt sur les plus-values de capital  | 2     | (1 035)              | (2 026)              |
| Retenue à la source sur produits d'investissement   | 2     | (95 635)             | (76 995)             |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(126 503 266)</b> | <b>(127 210 420)</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.



## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|---|----------------------|----------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier               | 1 915 056 166        | 1 955 613 232        |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(126 503 266)</b> | <b>(127 210 420)</b> |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                      |                      |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 1 645 749 720        | 532 616 746          |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (771 909 819)        | (445 963 392)        |
| Augmentation des actifs nets résultant d'opérations sur actions   | 873 839 901          | 86 653 354           |
| <b>Augmentation/(Diminution) totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>    | <b>747 336 635</b>   | <b>(40 557 066)</b>  |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>        | <b>2 662 392 801</b> | <b>1 915 056 166</b> |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

| Notes   | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|---|----------------------|----------------------|
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(126 503 266)</b> | <b>(127 210 420)</b> |
| <b>Ajustement pour :</b>  |                      |                      |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | (728 152 862)        | 56 571 317           |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés   | (13 561 474)         | 303 839              |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   | <b>(868 217 602)</b> | <b>(70 335 264)</b>  |
| Variation des montants à recevoir   | (6 473 325)          | 59 840               |
| Variation des montants à payer  | 61 915               | (9 506)              |
| <b>Entrées de trésorerie sur opérations</b>   | <b>(6 411 410)</b>   | <b>50 334</b>        |
| <b>Sorties de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  | <b>(874 629 012)</b> | <b>(70 284 930)</b>  |
| <b>Activités de financement</b>   |                      |                      |
| Produits des souscriptions  | 5 1 645 749 720      | 532 616 746          |
| Paiements sur rachats   | 5 (771 909 819)      | (445 963 392)        |
| <b>Trésorerie nette générée sur activités de financement</b>  | <b>873 839 901</b>   | <b>86 653 354</b>    |
| <b>(Diminution)/Augmentation nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>                                    | <b>(789 111)</b>     | <b>16 368 424</b>    |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  | 41 783 159           | 25 414 735           |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   | <b>40 994 048</b>    | <b>41 783 159</b>    |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie - État de la situation financière   | 41 378 838           | 41 783 159           |
| Découverts bancaires - État de la situation financière  | (384 790)            | -                    |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie - État des flux de trésorerie</b>  | <b>40 994 048</b>    | <b>41 783 159</b>    |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |                      |                      |
| Impôts payés  | (96 670)             | (79 021)             |
| Intérêts reçus  | 39 409 908           | 37 711 155           |
| Intérêts payés  | -                    | (65 905)             |
| Distributions payées  | (27 066 143)         | (21 174 801)         |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %)</b>                           |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %)</b>               |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %)</b>                     |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar australien – 0,05 %</b>   |                  |                   | <b>Dollar canadien – 0,49 % (suite)</b>                                 |                  |                   |
| 50 000 3.700% Asian Development Bank<br>17/06/2025                                  | 33 513           | 0,00              | 100 000 0.750% Asian Development Bank<br>10/02/2026                     | 68 053           | 0,00              |
| 200 000 0.500% Asian Development Bank<br>05/05/2026                                 | 121 671          | 0,01              | 300 000 4.000% AT&T Inc 25/11/2025                                      | 218 061          | 0,01              |
| 50 000 3.750% Ausgrid Finance Pty Ltd<br>30/10/2024                                 | 33 223           | 0,00              | 100 000 1.978% Bank of America Corp<br>15/09/2027                       | 67 013           | 0,00              |
| 50 000 4.200% AusNet Services Holdings Pty<br>Ltd 21/08/2028                        | 32 030           | 0,00              | 100 000 3.615% Bank of America Corp<br>16/03/2028                       | 70 447           | 0,00              |
| 150 000 3.100% European Investment Bank<br>17/08/2026                               | 98 751           | 0,00              | 100 000 2.280% Bank of Montreal 29/07/2024                              | 71 308           | 0,00              |
| 100 000 1.800% European Investment Bank<br>19/01/2027                               | 62 421           | 0,00              | 100 000 2.370% Bank of Montreal 03/02/2025                              | 70 667           | 0,00              |
| 200 000 0.750% European Investment Bank<br>15/07/2027                               | 117 981          | 0,01              | 200 000 3.650% Bank of Montreal 01/04/2027                              | 142 718          | 0,01              |
| 250 000 3.300% European Investment Bank<br>03/02/2028                               | 163 453          | 0,01              | 100 000 4.309% Bank of Montreal 01/06/2027                              | 73 094           | 0,00              |
| 100 000 2.849% General Property Trust<br>20/02/2032                                 | 53 312           | 0,00              | 200 000 4.709% Bank of Montreal 07/12/2027                              | 148 163          | 0,01              |
| 50 000 2.750% Inter-American Development<br>Bank 30/10/2025                         | 32 732           | 0,00              | 100 000 3.190% Bank of Montreal 01/03/2028                              | 70 286           | 0,00              |
| 200 000 0.500% International Bank for<br>Reconstruction & Development<br>18/05/2026 | 121 580          | 0,01              | 50 000 2.880% Bank of Montreal 17/09/2029                               | 35 529           | 0,00              |
| 100 000 3.000% International Bank for<br>Reconstruction & Development<br>19/10/2026 | 65 513           | 0,00              | 100 000 2.077% Bank of Montreal 17/06/2030                              | 68 860           | 0,00              |
| 50 000 3.300% International Bank for<br>Reconstruction & Development<br>14/08/2028  | 32 508           | 0,00              | 100 000 2.290% Bank of Nova Scotia<br>28/06/2024                        | 71 713           | 0,00              |
| 100 000 3.600% International Finance Corp<br>24/02/2026                             | 66 827           | 0,00              | 100 000 2.490% Bank of Nova Scotia<br>23/09/2024                        | 71 314           | 0,00              |
| 100 000 4.450% International Finance Corp<br>14/05/2027                             | 68 773           | 0,00              | 100 000 1.950% Bank of Nova Scotia<br>10/01/2025                        | 70 268           | 0,00              |
| 100 000 4.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>27/02/2025                        | 67 433           | 0,00              | 100 000 2.160% Bank of Nova Scotia<br>03/02/2025                        | 70 438           | 0,00              |
| 100 000 4.100% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>20/02/2026                        | 67 877           | 0,00              | 100 000 5.500% Bank of Nova Scotia<br>08/05/2026                        | 75 699           | 0,01              |
| 200 000 1.000% NBN Co Ltd 03/12/2025  | 122 825          | 0,01              | 100 000 1.850% Bank of Nova Scotia<br>02/11/2026                        | 67 303           | 0,00              |
| 100 000 4.750% NBN Co Ltd 28/09/2026  | 67 883           | 0,00              | 100 000 2.950% Bank of Nova Scotia<br>08/03/2027                        | 69 593           | 0,00              |
|   | <b>1 430 306</b> | <b>0,05</b>       | 100 000 1.400% Bank of Nova Scotia<br>01/11/2027                        | 64 307           | 0,00              |
| <b>Dollar canadien – 0,49 %</b>   |                  |                   | 100 000 3.100% Bank of Nova Scotia<br>02/02/2028                        | 70 018           | 0,00              |
| 50 000 4.190% 407 International Inc<br>25/04/2042                                   | 34 474           | 0,00              | 100 000 2.836% Bank of Nova Scotia<br>03/07/2029                        | 71 291           | 0,00              |
| 100 000 2.840% 407 International Inc<br>07/03/2050                                  | 53 353           | 0,00              | 100 000 3.934% Bank of Nova Scotia<br>03/05/2032                        | 69 829           | 0,00              |
| 50 000 3.056% Alimentation Couche-Tard Inc<br>26/07/2024                            | 36 054           | 0,00              | 100 000 3.350% Bell Telephone Co of Canada or<br>Bell Canada 12/03/2025 | 72 077           | 0,00              |
| 200 000 1.726% Allied Properties Real Estate<br>Investment Trust 12/02/2026         | 132 901          | 0,01              | 100 000 1.650% Bell Telephone Co of Canada or<br>Bell Canada 16/08/2027 | 65 780           | 0,00              |
| 100 000 4.320% Anheuser-Busch InBev Finance<br>Inc 15/05/2047                       | 64 498           | 0,00              | 100 000 3.800% Bell Telephone Co of Canada or<br>Bell Canada 21/08/2028 | 71 401           | 0,00              |
| 200 000 2.513% Apple Inc 19/08/2024   | 143 593          | 0,01              | 100 000 2.500% Bell Telephone Co of Canada or<br>Bell Canada 14/05/2030 | 64 281           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 3.000% Bell Telephone Co of Canada or<br>Bell Canada 17/03/2031 | 65 461           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 5.850% Bell Telephone Co of Canada or<br>Bell Canada 10/11/2032 | 79 300           | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar canadien – 0,49 % (suite)</b>                                 |                  |                   |
| 450 000 3.500% Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada 30/09/2050    | 245 611          | 0,01              |
| 100 000 5.431% Brookfield Finance II Inc 14/12/2032                     | 74 780           | 0,01              |
| 100 000 4.132% Bruce Power LP 21/06/2033                                | 69 012           | 0,00              |
| 100 000 2.350% Canadian Imperial Bank of Commerce 28/08/2024            | 71 260           | 0,00              |
| 100 000 2.750% Canadian Imperial Bank of Commerce 07/03/2025            | 71 148           | 0,00              |
| 200 000 2.000% Canadian Imperial Bank of Commerce 17/04/2025            | 139 863          | 0,01              |
| 100 000 3.300% Canadian Imperial Bank of Commerce 26/05/2025            | 72 196           | 0,00              |
| 200 000 1.100% Canadian Imperial Bank of Commerce 19/01/2026            | 134 112          | 0,01              |
| 100 000 4.950% Canadian Imperial Bank of Commerce 29/06/2027            | 74 700           | 0,01              |
| 200 000 5.050% Canadian Imperial Bank of Commerce 07/10/2027            | 149 914          | 0,01              |
| 100 000 2.950% Canadian Imperial Bank of Commerce 19/06/2029            | 71 419           | 0,00              |
| 100 000 2.010% Canadian Imperial Bank of Commerce 21/07/2030            | 68 483           | 0,00              |
| 50 000 3.420% Canadian Natural Resources Ltd 01/12/2026                 | 35 499           | 0,00              |
| 100 000 2.540% Canadian Pacific Railway Co 28/02/2028                   | 67 834           | 0,00              |
| 50 000 3.600% Cenovus Energy Inc 10/03/2027                             | 35 814           | 0,00              |
| 200 000 3.500% Cenovus Energy Inc 07/02/2028                            | 140 811          | 0,01              |
| 50 000 4.178% Choice Properties Real Estate Investment Trust 08/03/2028 | 35 491           | 0,00              |
| 50 000 2.963% CU Inc 07/09/2049   | 27 285           | 0,00              |
| 100 000 2.140% Daimler Truck Finance Canada Inc 13/12/2024              | 70 176           | 0,00              |
| 100 000 3.650% Enbridge Gas Inc 01/04/2050                              | 61 318           | 0,00              |
| 100 000 3.200% Enbridge Inc 08/06/2027                                  | 69 856           | 0,00              |
| 200 000 2.990% Enbridge Inc 03/10/2029                                  | 133 719          | 0,01              |
| 100 000 6.100% Enbridge Inc 09/11/2032                                  | 79 756           | 0,01              |
| 200 000 3.100% Enbridge Inc 21/09/2033                                  | 124 070          | 0,01              |
| 100 000 4.330% Enbridge Pipelines Inc 22/02/2049                        | 61 414           | 0,00              |
| 100 000 1.750% European Investment Bank 30/07/2024                      | 71 557           | 0,00              |
| 200 000 1.000% European Investment Bank 28/01/2028                      | 132 227          | 0,01              |
| 100 000 2.417% Federation des Caisses Desjardins du Quebec 04/10/2024   | 71 189           | 0,00              |
| 100 000 5.200% Federation des Caisses Desjardins du Quebec 01/10/2025   | 74 670           | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>             |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Dollar canadien – 0,49 % (suite)</b>                                       |                  |                   |
| 100 000 4.407% Federation des Caisses Desjardins du Quebec 19/05/2027         | 73 201           | 0,01              |
| 100 000 2.856% Federation des Caisses Desjardins du Quebec 26/05/2030         | 70 045           | 0,00              |
| 100 000 5.035% Federation des Caisses Desjardins du Quebec 23/08/2032         | 72 509           | 0,00              |
| 100 000 2.599% Goldman Sachs Group Inc 30/11/2027                             | 68 093           | 0,00              |
| 150 000 2.750% Greater Toronto Airports Authority 17/10/2039                  | 86 725           | 0,01              |
| 200 000 1.646% Honda Canada Finance Inc 25/02/2028                            | 128 576          | 0,01              |
| 200 000 3.403% HSBC Bank Canada 24/03/2025                                    | 143 924          | 0,01              |
| 100 000 1.782% HSBC Bank Canada 20/05/2026                                    | 67 850           | 0,00              |
| 100 000 3.020% Hydro One Inc 05/04/2029                                       | 69 944           | 0,00              |
| 100 000 3.630% Hydro One Inc 25/06/2049                                       | 62 716           | 0,00              |
| 100 000 5.760% Inter Pipeline Ltd 17/02/2028                                  | 75 631           | 0,01              |
| 100 000 4.232% Inter Pipeline Ltd/AB 01/06/2027                               | 71 622           | 0,00              |
| 100 000 3.983% Inter Pipeline Ltd/AB 25/11/2031                               | 66 281           | 0,00              |
| 200 000 1.700% Inter-American Development Bank 10/10/2024                     | 142 396          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Inter-American Development Bank 15/10/2025                     | 68 562           | 0,00              |
| 200 000 0.875% Inter-American Development Bank 27/08/2027                     | 132 423          | 0,01              |
| 100 000 1.800% International Bank for Reconstruction & Development 26/07/2024 | 71 622           | 0,00              |
| 100 000 1.900% International Bank for Reconstruction & Development 16/01/2025 | 71 186           | 0,00              |
| 200 000 0.750% International Bank for Reconstruction & Development 02/07/2025 | 138 031          | 0,01              |
| 200 000 0.625% International Bank for Reconstruction & Development 14/01/2026 | 135 808          | 0,01              |
| 100 000 1.800% International Bank for Reconstruction & Development 19/01/2027 | 69 407           | 0,00              |
| 100 000 0.875% International Bank for Reconstruction & Development 28/09/2027 | 66 055           | 0,00              |
| 100 000 1.896% JPMorgan Chase & Co 05/03/2028                                 | 66 342           | 0,00              |
| 200 000 0.750% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 19/02/2026                     | 136 064          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                      |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>                |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar canadien – 0,49 % (suite)</b>  |                  |                   | <b>Dollar canadien – 0,49 % (suite)</b>                                 |                  |                   |
| 100 000 3.049% Manulife Financial Corp<br>20/08/2029                                   | 71 666           | 0,00              | 100 000 3.369% Royal Bank of Canada<br>29/09/2025                       | 71 574           | 0,00              |
| 100 000 2.237% Manulife Financial Corp<br>12/05/2030                                   | 69 641           | 0,00              | 100 000 5.235% Royal Bank of Canada<br>02/11/2026                       | 75 462           | 0,01              |
| 100 000 2.818% Manulife Financial Corp<br>13/05/2035                                   | 63 511           | 0,00              | 100 000 2.328% Royal Bank of Canada<br>28/01/2027                       | 68 083           | 0,00              |
| 50 000 3.250% Mondelez International Inc<br>07/03/2025                                 | 35 906           | 0,00              | 100 000 4.612% Royal Bank of Canada<br>26/07/2027                       | 73 963           | 0,01              |
| 200 000 3.515% National Australia Bank Ltd<br>12/06/2030                               | 139 645          | 0,01              | 100 000 2.740% Royal Bank of Canada<br>25/07/2029                       | 71 090           | 0,00              |
| 100 000 5.296% National Bank of Canada<br>03/11/2025                                   | 74 891           | 0,01              | 100 000 2.880% Royal Bank of Canada<br>23/12/2029                       | 70 561           | 0,00              |
| 100 000 1.534% National Bank of Canada<br>15/06/2026                                   | 67 237           | 0,00              | 100 000 2.088% Royal Bank of Canada<br>30/06/2030                       | 68 770           | 0,00              |
| 100 000 2.237% National Bank of Canada<br>04/11/2026                                   | 68 158           | 0,00              | 100 000 2.140% Royal Bank of Canada<br>03/11/2031                       | 66 064           | 0,00              |
| 150 000 2.924% NAV Canada 29/09/2051   | 82 605           | 0,01              | 100 000 2.940% Royal Bank of Canada<br>03/05/2032                       | 67 318           | 0,00              |
| 100 000 2.192% Nestle Holdings Inc 26/01/2029  | 66 358           | 0,00              | 200 000 1.670% Royal Bank of Canada<br>28/01/2033                       | 124 731          | 0,01              |
| 100 000 2.000% New York Life Global Funding<br>17/04/2028                              | 65 895           | 0,00              | 100 000 6.750% Shaw Communications Inc<br>09/11/2039                    | 81 820           | 0,01              |
| 100 000 4.350% North West Redwater<br>Partnership / NWR Financing Co Ltd<br>10/01/2039 | 68 084           | 0,00              | 100 000 2.580% Sun Life Financial Inc<br>10/05/2032                     | 67 273           | 0,00              |
| 50 000 3.628% OMERS Realty Corp<br>05/06/2030  | 34 697           | 0,00              | 100 000 2.800% Sun Life Financial Inc<br>21/11/2033                     | 65 588           | 0,00              |
| 100 000 3.215% Ontario Power Generation Inc<br>08/04/2030                              | 68 744           | 0,00              | 100 000 2.060% Sun Life Financial Inc<br>01/10/2035                     | 59 611           | 0,00              |
| 25 000 4.740% Pembina Pipeline Corp<br>21/01/2047                                      | 16 126           | 0,00              | 100 000 3.300% TELUS Corp 02/05/2029                                    | 68 730           | 0,00              |
| 100 000 4.750% Pembina Pipeline Corp<br>26/03/2048                                     | 64 408           | 0,00              | 200 000 2.850% TELUS Corp 13/11/2031                                    | 127 017          | 0,01              |
| 100 000 4.540% Pembina Pipeline Corp<br>03/04/2049                                     | 61 982           | 0,00              | 100 000 5.250% TELUS Corp 15/11/2032                                    | 75 558           | 0,01              |
| 50 000 2.150% PepsiCo Inc 06/05/2024   | 35 953           | 0,00              | 100 000 3.950% TELUS Corp 16/02/2050                                    | 57 985           | 0,00              |
| 100 000 0.900% PSP Capital Inc 15/06/2026  | 67 881           | 0,00              | 100 000 2.239% Thomson Reuters Corp<br>14/05/2025                       | 70 385           | 0,00              |
| 100 000 3.100% Rogers Communications Inc<br>15/04/2025                                 | 71 500           | 0,00              | 100 000 3.226% Toronto-Dominion Bank<br>24/07/2024                      | 72 453           | 0,00              |
| 200 000 3.650% Rogers Communications Inc<br>31/03/2027                                 | 141 745          | 0,01              | 100 000 2.496% Toronto-Dominion Bank<br>02/12/2024                      | 71 036           | 0,00              |
| 100 000 3.750% Rogers Communications Inc<br>15/04/2029                                 | 69 745           | 0,00              | 100 000 1.943% Toronto-Dominion Bank<br>13/03/2025                      | 70 040           | 0,00              |
| 100 000 4.250% Rogers Communications Inc<br>15/04/2032                                 | 69 403           | 0,00              | 200 000 2.667% Toronto-Dominion Bank<br>09/09/2025                      | 140 942          | 0,01              |
| 100 000 5.250% Rogers Communications Inc<br>15/04/2052                                 | 69 401           | 0,00              | 200 000 1.128% Toronto-Dominion Bank<br>09/12/2025                      | 134 817          | 0,01              |
| 200 000 2.352% Royal Bank of Canada<br>02/07/2024                                      | 143 023          | 0,01              | 100 000 4.210% Toronto-Dominion Bank<br>01/06/2027                      | 72 802           | 0,00              |
| 100 000 2.609% Royal Bank of Canada<br>01/11/2024                                      | 71 284           | 0,00              | 200 000 5.376% Toronto-Dominion Bank<br>21/10/2027                      | 152 209          | 0,01              |
| 100 000 1.936% Royal Bank of Canada<br>01/05/2025                                      | 69 830           | 0,00              | 100 000 1.896% Toronto-Dominion Bank<br>11/09/2028                      | 64 621           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD  | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                   |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                 |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                   |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>           |                  |                   |
| <b>Dollar canadien – 0,49 % (suite)</b>                                 |                   |                   | <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 200 000 4.680% Toronto-Dominion Bank 08/01/2029                         | 148 637           | 0,01              | 100 000 0.375% Abbott Ireland Financing DAC 19/11/2027                            | 95 248           | 0,00              |
| 50 000 3.224% Toronto-Dominion Bank 25/07/2029                          | 35 788            | 0,00              | 100 000 1.250% AbbVie Inc 01/06/2024  | 105 823          | 0,01              |
| 50 000 3.105% Toronto-Dominion Bank 22/04/2030                          | 35 282            | 0,00              | 100 000 0.750% AbbVie Inc 18/11/2027  | 95 637           | 0,00              |
| 100 000 3.060% Toronto-Dominion Bank 26/01/2032                         | 68 148            | 0,00              | 100 000 2.625% AbbVie Inc 15/11/2028  | 102 706          | 0,01              |
| 200 000 2.310% Toyota Credit Canada Inc 23/10/2024                      | 142 160           | 0,01              | 100 000 6.250% ABEILLE VIE SA d'Assurances Vie et de Capitalisation SA 09/09/2033 | 106 557          | 0,01              |
| 250 000 3.800% TransCanada PipeLines Ltd 05/04/2027                     | 178 490           | 0,01              | 100 000 1.625% Abertis Infraestructuras SA 15/07/2029                             | 93 748           | 0,00              |
| 50 000 3.390% TransCanada PipeLines Ltd 15/03/2028                      | 34 739            | 0,00              | 300 000 0.875% ABN AMRO Bank NV 14/01/2026  | 305 499          | 0,01              |
| 100 000 5.330% TransCanada PipeLines Ltd 12/05/2032                     | 75 176            | 0,01              | 100 000 2.375% ABN AMRO Bank NV 01/06/2027  | 101 759          | 0,00              |
| 100 000 4.350% TransCanada PipeLines Ltd 06/06/2046                     | 61 304            | 0,00              | 100 000 4.000% ABN AMRO Bank NV 16/01/2028  | 107 892          | 0,01              |
| 50 000 4.180% TransCanada PipeLines Ltd 03/07/2048                      | 29 544            | 0,00              | 100 000 4.250% ABN AMRO Bank NV 21/02/2030  | 108 891          | 0,01              |
| 100 000 4.340% TransCanada PipeLines Ltd 15/10/2049                     | 60 397            | 0,00              | 100 000 1.500% ABN AMRO Bank NV 30/09/2030  | 97 057           | 0,00              |
| 150 000 4.555% Transurban Finance Co Pty Ltd 14/11/2028                 | 108 655           | 0,01              | 100 000 1.125% ABN AMRO Bank NV 12/01/2032  | 92 090           | 0,00              |
| 100 000 2.758% TWDC Enterprises 18 Corp 07/10/2024                      | 71 610            | 0,00              | 100 000 3.000% ABN AMRO Bank NV 01/06/2032  | 100 467          | 0,00              |
| 100 000 2.375% Verizon Communications Inc 22/03/2028                    | 67 063            | 0,00              | 100 000 1.250% ABN AMRO Bank NV 10/01/2033  | 91 305           | 0,00              |
| 100 000 2.500% Verizon Communications Inc 16/05/2030                    | 64 391            | 0,00              | 100 000 4.500% ABN AMRO Bank NV 21/11/2034  | 108 820          | 0,01              |
| 200 000 3.057% Walt Disney Co 30/03/2027                                | 139 952           | 0,01              | 100 000 0.375% ABN AMRO Bank NV 14/01/2035  | 78 751           | 0,00              |
| 100 000 2.493% Wells Fargo & Co 18/02/2027                              | 67 838            | 0,00              | 100 000 0.400% ABN AMRO Bank NV 17/09/2041  | 65 327           | 0,00              |
|   | <b>12 978 338</b> | <b>0,49</b>       | 100 000 1.375% Acciona Energia Financiacion Filiales SA 26/01/2032                | 89 103           | 0,00              |
|   |                   |                   | 100 000 2.625% ACEA SpA 15/07/2024  | 107 117          | 0,01              |
| <b>Euro – 7,84 %</b>  |                   |                   | 250 000 1.500% ACEA SpA 08/06/2027  | 251 646          | 0,01              |
| 150 000 3.000% 2i Rete Gas SpA 16/07/2024                               | 161 501           | 0,01              | 100 000 0.750% Acef Holding SCA 14/06/2028  | 81 226           | 0,00              |
| 100 000 1.500% A2A SpA 16/03/2028                                       | 96 655            | 0,00              | 100 000 3.000% Achmea Bank NV 31/01/2030  | 107 301          | 0,01              |
| 100 000 4.500% A2A SpA 19/09/2030                                       | 109 873           | 0,01              | 100 000 2.800% Acquirente Unico SpA 20/02/2026                                    | 104 449          | 0,01              |
| 100 000 0.625% A2A SpA 15/07/2031                                       | 81 335            | 0,00              | 100 000 1.250% Adecco International Financial Services BV 20/11/2029              | 91 205           | 0,00              |
| 100 000 0.010% Aareal Bank AG 08/07/2027                                | 94 926            | 0,00              | 100 000 0.500% Adecco International Financial Services BV 21/09/2031              | 81 727           | 0,00              |
| 50 000 3.000% Aareal Bank AG 11/10/2027                                 | 53 836            | 0,00              | 100 000 0.000% adidas AG 05/10/2028   | 91 209           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Aareal Bank AG 01/02/2029                                | 98 492            | 0,00              | 100 000 3.125% adidas AG 21/11/2029   | 106 222          | 0,01              |
| 100 000 0.125% Aareal Bank AG 01/02/2030                                | 88 617            | 0,00              | 100 000 0.010% Aegon Bank NV 16/11/2025   | 99 475           | 0,00              |
| 100 000 0.750% Abanca Corp Bancaria SA 28/05/2029                       | 92 918            | 0,00              | 100 000 2.750% Aeroports de Paris 05/06/2028                                      | 105 298          | 0,01              |
| 120 000 0.750% ABB Finance BV 16/05/2024                                | 126 713           | 0,01              | 100 000 1.000% Aeroports de Paris 05/01/2029                                      | 93 575           | 0,00              |
| 100 000 0.000% ABB Finance BV 19/01/2030                                | 86 599            | 0,00              | 100 000 1.500% Aeroports de Paris 02/07/2032                                      | 88 504           | 0,00              |
| 100 000 1.500% Abbott Ireland Financing DAC 27/09/2026                  | 102 163           | 0,01              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 0.500% African Development Bank 22/03/2027                      | 98 369           | 0,00              |
| 100 000 2.250% African Development Bank 14/09/2029                      | 103 609          | 0,01              |
| 100 000 0.800% AGCO International Holdings BV 06/10/2028                | 89 761           | 0,00              |
| 100 000 1.250% AIB Group PLC 28/05/2024                                 | 105 262          | 0,01              |
| 100 000 0.500% AIB Group PLC 17/11/2027                                 | 94 320           | 0,00              |
| 100 000 2.250% AIB Group PLC 04/04/2028                                 | 98 594           | 0,00              |
| 100 000 0.375% Air Liquide Finance SA 20/09/2033                        | 80 945           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Air Products and Chemicals Inc 05/05/2028                | 92 845           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Airbus SE 09/06/2026                                     | 102 006          | 0,01              |
| 200 000 2.375% Airbus SE 09/06/2040                                     | 171 109          | 0,01              |
| 100 000 1.750% Akelius Residential Property AB 07/02/2025               | 101 203          | 0,00              |
| 100 000 1.000% Akelius Residential Property Financing BV 17/01/2028     | 87 371           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Akelius Residential Property Financing BV 11/01/2029     | 83 962           | 0,00              |
| 100 000 0.375% Aktia Bank Oyj 05/03/2026                                | 99 901           | 0,00              |
| 100 000 1.625% Albemarle New Holding GmbH 25/11/2028                    | 95 451           | 0,00              |
| 100 000 1.250% ALD SA 02/03/2026  | 100 271          | 0,00              |
| 100 000 4.000% ALD SA 05/07/2027  | 107 265          | 0,01              |
| 100 000 0.875% Aliaxis Finance SA 08/11/2028                            | 83 686           | 0,00              |
| 100 000 1.875% Alimentation Couche-Tard Inc 06/05/2026                  | 101 768          | 0,00              |
| 100 000 0.875% Alliander NV 24/06/2032                                  | 88 139           | 0,00              |
| 100 000 0.000% Allianz Finance II BV 22/11/2026                         | 97 432           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Allianz Finance II BV 21/04/2031                         | 94 546           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Allianz Finance II BV 22/11/2033                         | 79 735           | 0,00              |
| 200 000 4.597% Allianz SE 07/09/2038                                    | 211 925          | 0,01              |
| 100 000 3.099% Allianz SE 06/07/2047                                    | 101 299          | 0,00              |
| 100 000 4.252% Allianz SE 05/07/2052                                    | 99 983           | 0,00              |
| 100 000 1.700% Altria Group Inc 15/06/2025                              | 103 695          | 0,01              |
| 100 000 1.375% AMCO - Asset Management Co SpA 27/01/2025                | 103 631          | 0,01              |
| 100 000 2.250% AMCO - Asset Management Co SpA 17/07/2027                | 98 942           | 0,00              |
| 100 000 0.750% AMCO - Asset Management Co SpA 20/04/2028                | 89 916           | 0,00              |
| 200 000 1.125% Amcor UK Finance PLC 23/06/2027                          | 192 482          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 1.950% American Honda Finance Corp 18/10/2024                   | 106 057          | 0,01              |
| 100 000 0.300% American Honda Finance Corp 07/07/2028                   | 91 417           | 0,00              |
| 100 000 0.750% American Medical Systems Europe BV 08/03/2025            | 102 849          | 0,01              |
| 100 000 1.375% American Medical Systems Europe BV 08/03/2028            | 97 797           | 0,00              |
| 100 000 1.625% American Medical Systems Europe BV 08/03/2031            | 93 179           | 0,00              |
| 100 000 0.450% American Tower Corp 15/01/2027                           | 94 868           | 0,00              |
| 100 000 0.875% American Tower Corp 21/05/2029                           | 87 407           | 0,00              |
| 100 000 0.950% American Tower Corp 05/10/2030                           | 83 482           | 0,00              |
| 100 000 1.000% American Tower Corp 15/01/2032                           | 80 225           | 0,00              |
| 100 000 0.750% Amphenol Technologies Holding GmbH 04/05/2026            | 100 038          | 0,00              |
| 100 000 3.450% Amprion GmbH 22/09/2027                                  | 107 786          | 0,01              |
| 100 000 3.971% Amprion GmbH 22/09/2032                                  | 110 555          | 0,01              |
| 100 000 1.625% Anglo American Capital PLC 11/03/2026                    | 101 820          | 0,00              |
| 100 000 5.000% Anglo American Capital PLC 15/03/2031                    | 111 546          | 0,01              |
| 100 000 4.750% Anglo American Capital PLC 21/09/2032                    | 109 384          | 0,01              |
| 200 000 2.700% Anheuser-Busch InBev SA/NV 31/03/2026                    | 212 592          | 0,01              |
| 100 000 1.150% Anheuser-Busch InBev SA/NV 22/01/2027                    | 100 009          | 0,00              |
| 200 000 1.500% Anheuser-Busch InBev SA/NV 18/04/2030                    | 193 080          | 0,01              |
| 100 000 2.875% Anheuser-Busch InBev SA/NV 02/04/2032                    | 102 758          | 0,01              |
| 100 000 2.000% Anheuser-Busch InBev SA/NV 23/01/2035                    | 90 186           | 0,00              |
| 100 000 3.700% Anheuser-Busch InBev SA/NV 02/04/2040                    | 102 518          | 0,01              |
| 100 000 0.200% ANZ New Zealand Int'l Ltd/ London 23/09/2027             | 92 146           | 0,00              |
| 100 000 2.000% APA Infrastructure Ltd 22/03/2027                        | 99 869           | 0,00              |
| 100 000 1.250% APA Infrastructure Ltd 15/03/2033                        | 79 906           | 0,00              |
| 100 000 0.875% Apple Inc 24/05/2025                                     | 103 759          | 0,01              |
| 100 000 0.000% Apple Inc 15/11/2025                                     | 100 353          | 0,00              |
| 100 000 1.625% Apple Inc 10/11/2026                                     | 103 087          | 0,01              |
| 100 000 2.000% Apple Inc 17/09/2027                                     | 103 528          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 1.375% Apple Inc 24/05/2029                                     | 98 048           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Apple Inc 15/11/2031                                     | 87 116           | 0,00              |
| 100 000 1.250% APRR SA 18/01/2028                                       | 98 313           | 0,00              |
| 100 000 1.875% APRR SA 03/01/2029                                       | 99 668           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Argenta Spaarbank NV 08/02/2029                          | 88 205           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Argentum Netherlands BV for Givaudan SA 17/09/2025       | 102 005          | 0,01              |
| 200 000 0.050% Arion Banki HF 05/10/2026                                | 191 382          | 0,01              |
| 100 000 0.010% Arkea Home Loans SFH SA 04/10/2030                       | 85 869           | 0,00              |
| 100 000 0.750% Arkema SA 03/12/2029                                     | 91 048           | 0,00              |
| 100 000 0.000% Aroundtown SA 16/07/2026                                 | 76 903           | 0,00              |
| 100 000 0.375% Aroundtown SA 15/04/2027                                 | 72 651           | 0,00              |
| 100 000 1.625% Aroundtown SA 31/01/2028                                 | 71 422           | 0,00              |
| 100 000 0.000% Arval Service Lease SA/France 01/10/2025                 | 98 391           | 0,00              |
| 200 000 4.000% Arval Service Lease SA/France 22/09/2026                 | 215 263          | 0,01              |
| 100 000 0.336% Asahi Group Holdings Ltd 19/04/2027                      | 94 836           | 0,00              |
| 100 000 0.541% Asahi Group Holdings Ltd 23/10/2028                      | 90 975           | 0,00              |
| 100 000 0.500% ASB Finance Ltd 24/09/2029                               | 87 509           | 0,00              |
| 100 000 0.625% ASB Finance Ltd/London 18/10/2024                        | 103 804          | 0,01              |
| 100 000 0.025% Asian Development Bank 31/01/2030                        | 89 098           | 0,00              |
| 100 000 1.950% Asian Development Bank 22/07/2032                        | 99 018           | 0,00              |
| 50 000 2.000% Asian Development Bank 10/06/2037                         | 47 299           | 0,00              |
| 100 000 1.375% ASML Holding NV 07/07/2026                               | 102 655          | 0,01              |
| 100 000 7.000% ASR Nederland NV 07/12/2043                              | 112 640          | 0,01              |
| 100 000 2.429% Assicurazioni Generali SpA 14/07/2031                    | 88 335           | 0,00              |
| 100 000 5.500% Assicurazioni Generali SpA 27/10/2047                    | 108 468          | 0,01              |
| 100 000 1.500% ASTM SpA 25/01/2030                                      | 87 409           | 0,00              |
| 100 000 2.375% ASTM SpA 25/11/2033                                      | 84 279           | 0,00              |
| 100 000 0.375% AstraZeneca PLC 03/06/2029                               | 90 628           | 0,00              |
| 100 000 0.250% AT&T Inc 04/03/2026                                      | 98 780           | 0,00              |
| 100 000 1.600% AT&T Inc 19/05/2028                                      | 97 972           | 0,00              |
| 300 000 2.350% AT&T Inc 05/09/2029                                      | 300 193          | 0,01              |
| 100 000 2.600% AT&T Inc 17/12/2029                                      | 100 996          | 0,00              |
| 100 000 0.800% AT&T Inc 04/03/2030                                      | 88 902           | 0,00              |
| 100 000 3.550% AT&T Inc 17/12/2032                                      | 105 528          | 0,01              |

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>              |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>        |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 2.600% AT&T Inc 19/05/2038   | 87 933           | 0,00              |
| 100 000 1.800% AT&T Inc 14/09/2039   | 76 250           | 0,00              |
| 100 000 0.366% Athene Global Funding 10/09/2026                                | 91 759           | 0,00              |
| 100 000 0.832% Athene Global Funding 08/01/2027                                | 91 150           | 0,00              |
| 100 000 1.500% AusNet Services Holdings Pty Ltd 26/02/2027                     | 99 359           | 0,00              |
| 100 000 3.205% Australia & New Zealand Banking Group Ltd 15/11/2024            | 108 076          | 0,01              |
| 100 000 1.125% Autoroutes du Sud de la France SA 20/04/2026                    | 101 239          | 0,00              |
| 100 000 1.250% Autoroutes du Sud de la France SA 18/01/2027                    | 100 598          | 0,00              |
| 100 000 1.375% Autoroutes du Sud de la France SA 21/02/2031                    | 92 782           | 0,00              |
| 100 000 2.000% Autostrade per l'Italia SpA 04/12/2028                          | 94 163           | 0,00              |
| 100 000 1.875% Autostrade per l'Italia SpA 26/09/2029                          | 91 328           | 0,00              |
| 100 000 2.000% Autostrade per l'Italia SpA 15/01/2030                          | 90 494           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Avinor AS 29/04/2025  | 102 915          | 0,01              |
| 200 000 0.750% Avinor AS 01/10/2030  | 176 787          | 0,01              |
| 100 000 0.500% AXA Bank Europe SCF 18/04/2025                                  | 102 371          | 0,01              |
| 100 000 0.010% AXA Bank Europe SCF 22/01/2027                                  | 95 950           | 0,00              |
| 100 000 0.050% AXA Home Loan SFH SA 05/07/2027                                 | 95 012           | 0,00              |
| 100 000 0.375% AXA Logistics Europe Master SCA 15/11/2026                      | 89 435           | 0,00              |
| 100 000 3.750% AXA SA 12/10/2030   | 109 277          | 0,01              |
| 100 000 1.375% AXA SA 07/10/2041   | 81 807           | 0,00              |
| 200 000 1.875% AXA SA 10/07/2042   | 161 972          | 0,01              |
| 100 000 4.250% AXA SA 10/03/2043   | 98 903           | 0,00              |
| 100 000 3.375% AXA SA 06/07/2047   | 101 255          | 0,00              |
| 200 000 3.750% AyT Cédulas Cajas X Fondo de Titulizacion de Activos 30/06/2025 | 217 305          | 0,01              |
| 100 000 1.000% Balder Finland Oyj 18/01/2027                                   | 83 131           | 0,00              |
| 150 000 1.000% Balder Finland Oyj 20/01/2029                                   | 108 016          | 0,01              |
| 100 000 2.000% Balder Finland Oyj 18/01/2031                                   | 69 345           | 0,00              |
| 100 000 2.875% Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 16/07/2024                  | 107 152          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 04/06/2025                   | 102 198          | 0,01              |
| 100 000 1.750% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 26/11/2025                   | 103 533          | 0,01              |



## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 0.875% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 22/11/2026            | 99 524           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 24/03/2027            | 97 425           | 0,00              |
| 100 000 3.125% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 17/07/2027            | 107 775          | 0,01              |
| 100 000 3.375% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 20/09/2027            | 107 014          | 0,01              |
| 100 000 0.875% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 14/01/2029            | 92 620           | 0,00              |
| 100 000 4.375% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 14/10/2029            | 111 548          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Banco BPM SpA 15/03/2027                                 | 97 678           | 0,00              |
| 100 000 3.500% Banco de Sabadell SA 28/08/2026                          | 108 935          | 0,01              |
| 100 000 1.000% Banco de Sabadell SA 26/04/2027                          | 98 769           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Banco de Sabadell SA 10/02/2028                          | 92 803           | 0,00              |
| 100 000 1.750% Banco de Sabadell SA 30/05/2029                          | 98 446           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Banco Santander SA 17/01/2025                            | 103 629          | 0,01              |
| 100 000 0.010% Banco Santander SA 27/02/2025                            | 101 680          | 0,00              |
| 200 000 1.000% Banco Santander SA 07/04/2025                            | 206 767          | 0,01              |
| 200 000 1.375% Banco Santander SA 05/01/2026                            | 202 460          | 0,01              |
| 100 000 3.625% Banco Santander SA 27/09/2026                            | 107 740          | 0,01              |
| 100 000 3.125% Banco Santander SA 19/01/2027                            | 104 035          | 0,01              |
| 100 000 0.500% Banco Santander SA 04/02/2027                            | 94 925           | 0,00              |
| 200 000 1.125% Banco Santander SA 23/06/2027                            | 194 305          | 0,01              |
| 100 000 2.375% Banco Santander SA 08/09/2027                            | 104 298          | 0,01              |
| 100 000 2.125% Banco Santander SA 08/02/2028                            | 97 438           | 0,00              |
| 100 000 0.250% Banco Santander SA 10/07/2029                            | 89 584           | 0,00              |
| 100 000 0.100% Banco Santander SA 27/02/2032                            | 81 349           | 0,00              |
| 100 000 2.750% Banco Santander SA 08/09/2032                            | 102 913          | 0,01              |
| 100 000 2.375% Bank of America Corp 19/06/2024                          | 106 995          | 0,01              |
| 100 000 1.949% Bank of America Corp 27/10/2026                          | 103 051          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 0.583% Bank of America Corp 24/08/2028                          | 92 827           | 0,00              |
| 100 000 0.654% Bank of America Corp 26/10/2031                          | 84 345           | 0,00              |
| 100 000 2.824% Bank of America Corp 27/04/2033                          | 97 076           | 0,00              |
| 100 000 2.750% Bank of Montreal 13/10/2026                              | 106 158          | 0,01              |
| 100 000 0.125% Bank of Montreal 26/01/2027                              | 96 015           | 0,00              |
| 100 000 0.050% Bank of Montreal 08/06/2029                              | 89 096           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Bank of Nova Scotia 22/01/2025                           | 102 965          | 0,01              |
| 200 000 0.450% Bank of Nova Scotia 16/03/2026                           | 198 920          | 0,01              |
| 100 000 0.010% Bank of Nova Scotia 14/01/2027                           | 95 618           | 0,00              |
| 100 000 0.250% Bank of Nova Scotia 01/11/2028                           | 88 553           | 0,00              |
| 200 000 0.010% Bank of Nova Scotia 14/09/2029                           | 175 501          | 0,01              |
| 100 000 0.375% Bank of Nova Scotia 26/03/2030                           | 88 868           | 0,00              |
| 100 000 0.625% Bankinter SA 06/10/2027                                  | 92 996           | 0,00              |
| 100 000 3.050% Bankinter SA 29/05/2028                                  | 106 417          | 0,01              |
| 100 000 1.000% Banque Federative du Credit Mutuel SA 23/05/2025         | 102 769          | 0,01              |
| 100 000 0.010% Banque Federative du Credit Mutuel SA 11/05/2026         | 96 919           | 0,00              |
| 100 000 3.125% Banque Federative du Credit Mutuel SA 14/09/2027         | 106 018          | 0,01              |
| 100 000 0.625% Banque Federative du Credit Mutuel SA 19/11/2027         | 92 758           | 0,00              |
| 100 000 3.875% Banque Federative du Credit Mutuel SA 26/01/2028         | 106 919          | 0,01              |
| 100 000 0.250% Banque Federative du Credit Mutuel SA 29/06/2028         | 91 596           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Banque Federative du Credit Mutuel SA 16/07/2028         | 95 857           | 0,00              |
| 100 000 1.750% Banque Federative du Credit Mutuel SA 15/03/2029         | 94 924           | 0,00              |
| 200 000 1.875% Banque Federative du Credit Mutuel SA 18/06/2029         | 185 507          | 0,01              |
| 100 000 2.625% Banque Federative du Credit Mutuel SA 06/11/2029         | 99 073           | 0,00              |
| 100 000 4.000% Banque Federative du Credit Mutuel SA 21/11/2029         | 110 904          | 0,01              |
| 100 000 1.250% Banque Federative du Credit Mutuel SA 03/06/2030         | 89 427           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Banque Federative du Credit Mutuel SA 19/01/2032         | 85 076           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>   |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>           |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>                                   |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>     |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   | <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 3.875% Banque Federative du Credit Mutuel SA 16/06/2032   | 104 326          | 0,01              | 300 000 1.000% Bayerische Landesbank 23/09/2031                             | 270 793          | 0,01              |
| 100 000 4.000% Banque Federative du Credit Mutuel SA 26/01/2033   | 106 165          | 0,01              | 50 000 0.250% Bayerische Landesbodenkreditanstalt 21/03/2036                | 37 911           | 0,00              |
| 100 000 3.750% Banque Federative du Credit Mutuel SA 01/02/2033   | 108 009          | 0,01              | 100 000 1.336% Becton Dickinson Euro Finance Sarl 13/08/2041                | 67 868           | 0,00              |
| 100 000 3.375% Barclays PLC 02/04/2025  | 107 733          | 0,01              | 100 000 3.125% Belfius Bank SA 11/05/2026                                   | 103 799          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Barclays PLC 09/06/2025  | 104 263          | 0,01              | 100 000 0.000% Belfius Bank SA 28/08/2026                                   | 95 124           | 0,00              |
| 100 000 2.885% Barclays PLC 31/01/2027  | 103 481          | 0,01              | 100 000 0.125% Belfius Bank SA 14/09/2026                                   | 97 681           | 0,00              |
| 100 000 1.106% Barclays PLC 12/05/2032  | 80 997           | 0,00              | 100 000 3.000% Belfius Bank SA 15/02/2027                                   | 107 792          | 0,01              |
| 100 000 5.262% Barclays PLC 29/01/2034  | 110 676          | 0,01              | 100 000 1.250% Belfius Bank SA 06/04/2034                                   | 85 277           | 0,00              |
| 100 000 0.750% BASF SE 17/03/2026   | 101 443          | 0,00              | 100 000 1.500% Berkshire Hathaway Finance Corp 18/03/2030                   | 95 593           | 0,00              |
| 100 000 0.250% BASF SE 05/06/2027   | 96 440           | 0,00              | 100 000 2.000% Berkshire Hathaway Finance Corp 18/03/2034                   | 92 279           | 0,00              |
| 100 000 1.500% BASF SE 17/03/2031   | 94 431           | 0,00              | 100 000 1.625% Berkshire Hathaway Inc 16/03/2035                            | 86 013           | 0,00              |
| 50 000 1.625% BASF SE 15/11/2037  | 40 563           | 0,00              | 100 000 0.500% Berkshire Hathaway Inc 15/01/2041                            | 58 747           | 0,00              |
| 100 000 2.750% BAT International Finance PLC 25/03/2025   | 106 623          | 0,01              | 75 000 0.375% Berlin Hyp AG 21/02/2025                                      | 77 064           | 0,00              |
| 100 000 2.375% Bausparkasse Schwaebisch Hall AG 13/09/2029  | 104 306          | 0,01              | 81 000 1.250% Berlin Hyp AG 25/08/2025                                      | 84 076           | 0,00              |
| 100 000 0.010% Bausparkasse Schwaebisch Hall AG 22/10/2030  | 86 418           | 0,00              | 100 000 1.000% Berlin Hyp AG 05/02/2026                                     | 99 781           | 0,00              |
| 100 000 2.000% Bausparkasse Schwaebisch Hall AG 17/05/2034  | 97 169           | 0,00              | 50 000 0.010% Berlin Hyp AG 24/08/2026                                      | 48 853           | 0,00              |
| 100 000 0.010% BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 02/10/2029 | 88 259           | 0,00              | 100 000 0.010% Berlin Hyp AG 17/02/2027                                     | 96 402           | 0,00              |
| 100 000 0.010% BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 23/09/2030 | 85 492           | 0,00              | 100 000 0.010% Berlin Hyp AG 19/07/2027                                     | 95 254           | 0,00              |
| 200 000 2.000% BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 25/08/2032 | 194 020          | 0,01              | 50 000 0.375% Berlin Hyp AG 29/05/2029                                      | 46 235           | 0,00              |
| 100 000 1.300% Baxter International Inc 15/05/2029  | 92 076           | 0,00              | 100 000 0.125% Berlin Hyp AG 18/01/2030                                     | 89 434           | 0,00              |
| 100 000 0.050% Bayer AG 31/12/2025  | 102 075          | 0,01              | 100 000 0.250% Berlin Hyp AG 19/05/2033                                     | 82 138           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Bayer AG 06/01/2030  | 90 515           | 0,00              | 100 000 1.500% Berry Global Inc 15/01/2027                                  | 96 740           | 0,00              |
| 200 000 0.625% Bayer AG 12/07/2031  | 165 203          | 0,01              | 100 000 1.250% Bertelsmann SE & Co KGaA 29/09/2025                          | 103 095          | 0,01              |
| 100 000 1.375% Bayer AG 06/07/2032  | 85 811           | 0,00              | 100 000 3.500% Bertelsmann SE & Co KGaA 29/05/2029                          | 107 073          | 0,01              |
| 100 000 1.000% Bayer AG 12/01/2036  | 74 262           | 0,00              | 100 000 1.000% Bevco Lux Sarl 16/01/2030                                    | 84 548           | 0,00              |
| 100 000 1.500% Bayer Capital Corp BV 26/06/2026   | 101 418          | 0,00              | 100 000 2.250% BG Energy Capital PLC 21/11/2029                             | 99 442           | 0,00              |
| 100 000 0.625% Bayerische Landesbank 19/07/2027   | 97 983           | 0,00              | 100 000 3.250% BHP Billiton Finance Ltd 24/09/2027                          | 106 059          | 0,01              |
| 50 000 0.750% Bayerische Landesbank 19/01/2028  | 48 738           | 0,00              | 100 000 3.125% BHP Billiton Finance Ltd 29/04/2033                          | 100 287          | 0,00              |
| 50 000 0.750% Bayerische Landesbank 05/02/2029  | 47 733           | 0,00              | 100 000 1.250% BlackRock Inc 06/05/2025                                     | 103 327          | 0,01              |
| 50 000 0.125% Bayerische Landesbank 02/11/2029  | 45 016           | 0,00              | 100 000 1.000% Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 20/10/2026 | 89 259           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 1.250% Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 26/04/2027 | 86 525           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 1.000% Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 04/05/2028 | 80 996           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>           |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>     |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   | <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 3.625% Blackstone Property Partners Europe Holdings Sart 29/10/2029 | 88 983           | 0,00              | 100 000 1.953% BP Capital Markets PLC 03/03/2025                        | 105 983          | 0,01              |
| 100 000 0.500% BMW Finance NV 22/02/2025                                    | 103 836          | 0,01              | 100 000 1.104% BP Capital Markets PLC 15/11/2034                        | 78 819           | 0,00              |
| 50 000 0.000% BMW Finance NV 11/01/2026                                     | 50 002           | 0,00              | 300 000 3.250% BP Capital Markets PLC (Perpetual)                       | 301 102          | 0,01              |
| 150 000 0.750% BMW Finance NV 13/07/2026                                    | 151 320          | 0,01              | 100 000 3.625% BP Capital Markets PLC (Perpetual)                       | 94 658           | 0,00              |
| 130 000 1.000% BMW Finance NV 22/05/2028                                    | 126 503          | 0,01              | 200 000 1.000% BPCE SA 15/07/2024                                       | 210 243          | 0,01              |
| 50 000 1.500% BMW Finance NV 06/02/2029                                     | 49 375           | 0,00              | 100 000 0.625% BPCE SA 26/09/2024                                       | 103 646          | 0,01              |
| 200 000 1.000% BNP Paribas Cardif SA 29/11/2024                             | 205 967          | 0,01              | 100 000 0.625% BPCE SA 28/04/2025                                       | 101 975          | 0,01              |
| 100 000 0.375% BNP Paribas Home Loan SFH SA 07/05/2025                      | 102 045          | 0,01              | 100 000 1.375% BPCE SA 23/03/2026                                       | 100 886          | 0,00              |
| 100 000 3.000% BNP Paribas Home Loan SFH SA 31/01/2030                      | 107 576          | 0,01              | 100 000 0.010% BPCE SA 14/01/2027                                       | 94 101           | 0,00              |
| 100 000 1.000% BNP Paribas SA 17/04/2024                                    | 105 649          | 0,01              | 100 000 1.750% BPCE SA 26/04/2027                                       | 100 492          | 0,00              |
| 100 000 0.500% BNP Paribas SA 15/07/2025                                    | 103 816          | 0,01              | 100 000 0.500% BPCE SA 15/09/2027                                       | 95 172           | 0,00              |
| 100 000 2.125% BNP Paribas SA 23/01/2027                                    | 102 396          | 0,01              | 100 000 0.500% BPCE SA 14/01/2028                                       | 93 908           | 0,00              |
| 100 000 0.375% BNP Paribas SA 14/10/2027                                    | 95 164           | 0,00              | 100 000 4.375% BPCE SA 13/07/2028                                       | 109 401          | 0,01              |
| 100 000 0.500% BNP Paribas SA 19/02/2028                                    | 93 686           | 0,00              | 300 000 0.250% BPCE SA 14/01/2031                                       | 245 856          | 0,01              |
| 100 000 1.500% BNP Paribas SA 25/05/2028                                    | 97 213           | 0,00              | 100 000 1.000% BPCE SA 14/01/2032                                       | 84 037           | 0,00              |
| 100 000 3.625% BNP Paribas SA 01/09/2029                                    | 105 188          | 0,01              | 200 000 2.250% BPCE SA 02/03/2032                                       | 194 227          | 0,01              |
| 100 000 0.500% BNP Paribas SA 19/01/2030                                    | 87 191           | 0,00              | 100 000 2.375% BPCE SA 26/04/2032                                       | 96 254           | 0,00              |
| 100 000 1.625% BNP Paribas SA 02/07/2031                                    | 85 101           | 0,00              | 100 000 4.000% BPCE SA 29/11/2032                                       | 108 807          | 0,01              |
| 100 000 2.100% BNP Paribas SA 07/04/2032                                    | 91 795           | 0,00              | 100 000 0.010% BPCE SFH SA 21/01/2027                                   | 96 085           | 0,00              |
| 100 000 0.875% BNP Paribas SA 31/08/2033                                    | 86 442           | 0,00              | 200 000 3.125% BPCE SFH SA 20/07/2027                                   | 216 160          | 0,01              |
| 100 000 0.375% BNZ International Funding Ltd/ London 14/09/2024             | 103 656          | 0,01              | 100 000 0.625% BPCE SFH SA 22/09/2027                                   | 96 953           | 0,00              |
| 100 000 0.625% BNZ International Funding Ltd/ London 03/07/2025             | 101 724          | 0,00              | 200 000 3.125% BPCE SFH SA 24/01/2028                                   | 216 045          | 0,01              |
| 100 000 0.100% Booking Holdings Inc 08/03/2025                              | 101 769          | 0,00              | 100 000 0.010% BPCE SFH SA 23/03/2028                                   | 92 665           | 0,00              |
| 100 000 1.800% Booking Holdings Inc 03/03/2027                              | 101 796          | 0,00              | 100 000 0.010% BPCE SFH SA 16/10/2028                                   | 91 185           | 0,00              |
| 100 000 4.250% Booking Holdings Inc 15/05/2029                              | 111 873          | 0,01              | 100 000 0.010% BPCE SFH SA 29/01/2029                                   | 90 334           | 0,00              |
| 100 000 4.500% Booking Holdings Inc 15/11/2031                              | 113 014          | 0,01              | 100 000 1.125% BPCE SFH SA 12/04/2030                                   | 94 472           | 0,00              |
| 100 000 1.000% BorgWamer Inc 19/05/2031                                     | 85 618           | 0,00              | 100 000 0.010% BPCE SFH SA 27/05/2030                                   | 86 598           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Bouygues SA 24/07/2028                                       | 97 715           | 0,00              | 100 000 0.125% BPCE SFH SA 03/12/2030                                   | 86 067           | 0,00              |
| 100 000 2.250% Bouygues SA 29/06/2029                                       | 100 573          | 0,00              | 100 000 3.125% BPCE SFH SA 20/01/2033                                   | 107 127          | 0,01              |
| 100 000 4.625% Bouygues SA 07/06/2032                                       | 115 033          | 0,01              | 100 000 0.500% BPCE SFH SA 23/01/2035                                   | 78 910           | 0,00              |
| 100 000 5.375% Bouygues SA 30/06/2042                                       | 118 116          | 0,01              | 100 000 0.010% BPCE SFH SA 29/01/2036                                   | 71 110           | 0,00              |
| 100 000 0.933% BP Capital Markets BV 04/12/2040                             | 65 064           | 0,00              | 100 000 2.375% Brambles Finance Ltd 12/06/2024                          | 106 690          | 0,01              |
| 100 000 1.467% BP Capital Markets BV 21/09/2041                             | 70 533           | 0,00              | 100 000 1.125% Brenntag Finance BV 27/09/2025                           | 102 747          | 0,01              |
| 300 000 1.876% BP Capital Markets PLC 07/04/2024                            | 321 007          | 0,01              | 100 000 1.750% Bright Food Singapore Holdings Pte Ltd 22/07/2025        | 98 886           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 1.125% British Telecommunications PLC 12/09/2029                | 92 259           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 3.375% British Telecommunications PLC 30/08/2032                | 102 157          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                                    |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>                              |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 0.625% Cadent Finance PLC 19/03/2030   | 87 505           | 0,00              |
| 100 000 0.750% Cadent Finance PLC 11/03/2032   | 82 693           | 0,00              |
| 200 000 2.750% Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 25/11/2032                                 | 211 593          | 0,01              |
| 100 000 0.010% Caisse de Refinancement de l'Habitat SA 27/11/2026                                    | 96 877           | 0,00              |
| 300 000 0.125% Caisse de Refinancement de l'Habitat SA 30/04/2027                                    | 287 843          | 0,01              |
| 100 000 6.000% Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 23/01/2027                 | 111 546          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 07/07/2028                 | 88 153           | 0,00              |
| 100 000 3.750% Caisse Nationale des Autoroutes 15/07/2025  | 109 773          | 0,01              |
| 100 000 5.750% Caixa Geral de Depositos SA 31/10/2028  | 112 040          | 0,01              |
| 100 000 0.625% CaixaBank SA 01/10/2024   | 103 561          | 0,01              |
| 100 000 4.000% CaixaBank SA 03/02/2025   | 109 367          | 0,01              |
| 100 000 1.625% CaixaBank SA 13/04/2026   | 102 731          | 0,01              |
| 200 000 0.750% CaixaBank SA 10/07/2026   | 202 616          | 0,01              |
| 200 000 1.125% CaixaBank SA 12/11/2026   | 195 954          | 0,01              |
| 100 000 0.375% CaixaBank SA 18/11/2026   | 97 862           | 0,00              |
| 100 000 1.000% CaixaBank SA 17/01/2028   | 97 425           | 0,00              |
| 100 000 0.625% CaixaBank SA 21/01/2028   | 96 458           | 0,00              |
| 100 000 0.750% CaixaBank SA 26/05/2028   | 93 412           | 0,00              |
| 100 000 3.750% CaixaBank SA 07/09/2029   | 108 301          | 0,01              |
| 100 000 2.250% CaixaBank SA 17/04/2030   | 100 890          | 0,00              |
| 100 000 5.375% CaixaBank SA 14/11/2030   | 112 406          | 0,01              |
| 100 000 0.040% Canadian Imperial Bank of Commerce 09/07/2027   | 94 308           | 0,00              |
| 100 000 1.680% Canal de Isabel II Gestion SA 26/02/2025  | 104 563          | 0,01              |
| 100 000 1.750% Capgemini SE 18/04/2028   | 98 795           | 0,00              |
| 100 000 2.000% Capgemini SE 15/04/2029   | 98 498           | 0,00              |
| 200 000 1.250% Carrefour SA 03/06/2025   | 206 621          | 0,01              |
| 100 000 2.000% Castellum Helsinki Finance Holding Abp 24/03/2025                                     | 98 599           | 0,00              |
| 100 000 0.500% CBRE Global Investors Open-Ended Fund SCA SICAV-SIF Pan European Core Fund 27/01/2028 | 77 358           | 0,00              |
| 100 000 0.900% CBRE Global Investors Open-Ended Fund SCA SICAV-SIF Pan European Core Fund 12/10/2029 | 72 399           | 0,00              |
| 100 000 0.500% CCEP Finance Ireland DAC 06/09/2029   | 89 178           | 0,00              |

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>          |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>    |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 3.875% Cédulas TDA 6 Fondo de Titulizacion de Activos 23/05/2025   | 109 061          | 0,01              |
| 100 000 4.777% Celanese US Holdings LLC 19/07/2026                         | 106 864          | 0,01              |
| 100 000 1.000% Cepsa Finance SA 16/02/2025                                 | 103 638          | 0,01              |
| 100 000 2.250% Cepsa Finance SA 13/02/2026                                 | 104 373          | 0,01              |
| 100 000 6.693% Ceska sportelna AS 14/11/2025                               | 110 887          | 0,01              |
| 100 000 1.500% Ceske Drahy AS 23/05/2026                                   | 97 907           | 0,00              |
| 100 000 5.625% Ceske Drahy AS 12/10/2027                                   | 111 372          | 0,01              |
| 100 000 0.875% CEZ AS 02/12/2026   | 96 413           | 0,00              |
| 100 000 2.706% Channel Link Enterprises Finance PLC 30/06/2050             | 98 872           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd 12/12/2024       | 101 942          | 0,01              |
| 100 000 0.000% China Construction Bank Europe SA 28/06/2024                | 102 913          | 0,01              |
| 100 000 0.875% Chubb INA Holdings Inc 15/12/2029                           | 89 979           | 0,00              |
| 100 000 0.050% Cie de Financement Foncier SA 16/04/2024                    | 104 949          | 0,01              |
| 100 000 4.000% Cie de Financement Foncier SA 24/10/2025                    | 110 309          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Cie de Financement Foncier SA 29/05/2026                    | 100 464          | 0,00              |
| 100 000 0.010% Cie de Financement Foncier SA 15/07/2026                    | 97 732           | 0,00              |
| 100 000 0.225% Cie de Financement Foncier SA 14/09/2026                    | 97 910           | 0,00              |
| 100 000 3.125% Cie de Financement Foncier SA 18/05/2027                    | 108 087          | 0,01              |
| 100 000 0.010% Cie de Financement Foncier SA 10/11/2027                    | 93 789           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Cie de Financement Foncier SA 16/03/2028                    | 95 209           | 0,00              |
| 200 000 0.875% Cie de Financement Foncier SA 11/09/2028                    | 192 191          | 0,01              |
| 100 000 0.010% Cie de Financement Foncier SA 16/04/2029                    | 89 890           | 0,00              |
| 200 000 1.250% Cie de Financement Foncier SA 15/11/2032                    | 182 204          | 0,01              |
| 50 000 3.875% Cie de Financement Foncier SA 25/04/2055                     | 62 572           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Cie de Saint-Gobain 14/06/2027                              | 99 881           | 0,00              |
| 100 000 2.375% Cie de Saint-Gobain 04/10/2027                              | 103 487          | 0,01              |
| 100 000 0.375% Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 07/02/2025 | 102 810          | 0,01              |
| 100 000 1.000% Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 19/05/2031 | 89 744           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 0.000% Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 02/11/2028  | 90 436           | 0,00              |
| 100 000 0.250% Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 02/11/2032  | 82 586           | 0,00              |
| 100 000 1.500% CIMIC Finance Ltd 28/05/2029                             | 82 858           | 0,00              |
| 100 000 2.375% Citigroup Inc 22/05/2024                                 | 106 971          | 0,01              |
| 200 000 1.250% Citigroup Inc 06/07/2026                                 | 203 694          | 0,01              |
| 100 000 0.500% Citigroup Inc 08/10/2027                                 | 95 503           | 0,00              |
| 100 000 3.713% Citigroup Inc 22/09/2028                                 | 106 768          | 0,01              |
| 100 000 4.112% Citigroup Inc 22/09/2033                                 | 105 894          | 0,01              |
| 100 000 0.750% CK Hutchison Europe Finance 21 Ltd 02/11/2029            | 86 689           | 0,00              |
| 100 000 1.000% CK Hutchison Europe Finance 21 Ltd 02/11/2033            | 78 242           | 0,00              |
| 100 000 1.125% CK Hutchison Group Telecom Finance SA 17/10/2028         | 91 253           | 0,00              |
| 100 000 0.375% CNP Assurances 08/03/2028                                | 88 529           | 0,00              |
| 100 000 4.500% CNP Assurances 10/06/2047                                | 106 206          | 0,01              |
| 100 000 2.000% CNP Assurances 27/07/2050                                | 88 126           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Coca-Cola Co 09/03/2029                                  | 89 768           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Coca-Cola Co 15/03/2029                                  | 89 488           | 0,00              |
| 100 000 0.400% Coca-Cola Co 06/05/2030                                  | 88 256           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Coca-Cola Co 09/03/2033                                  | 81 867           | 0,00              |
| 100 000 0.375% Coca-Cola Co 15/03/2033                                  | 80 750           | 0,00              |
| 100 000 1.625% Coca-Cola Co 09/03/2035                                  | 88 522           | 0,00              |
| 200 000 0.950% Coca-Cola Co 06/05/2036                                  | 157 961          | 0,01              |
| 100 000 1.125% Coca-Cola Europacific Partners PLC 26/05/2024            | 105 620          | 0,01              |
| 100 000 1.500% Coca-Cola Europacific Partners PLC 08/11/2027            | 98 568           | 0,00              |
| 100 000 1.875% Coca-Cola Europacific Partners PLC 18/03/2030            | 95 310           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Coca-Cola HBC Finance BV 14/05/2027                      | 97 619           | 0,00              |
| 100 000 1.625% Coca-Cola HBC Finance BV 14/05/2031                      | 91 823           | 0,00              |
| 100 000 0.875% Coentreprise de Transport d'Electricite SA 29/09/2024    | 104 386          | 0,01              |
| 100 000 2.125% Coentreprise de Transport d'Electricite SA 29/07/2032    | 93 655           | 0,00              |
| 100 000 0.300% Colgate-Palmolive Co 10/11/2029                          | 91 290           | 0,00              |
| 100 000 2.750% Coloplast Finance BV 19/05/2030                          | 101 972          | 0,01              |
| 100 000 0.000% Comcast Corp 14/09/2026                                  | 96 460           | 0,00              |
| 100 000 0.250% Comcast Corp 14/09/2029                                  | 87 764           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 0.625% Commerzbank AG 28/08/2024                                | 103 699          | 0,01              |
| 200 000 0.250% Commerzbank AG 16/09/2024                                | 205 306          | 0,01              |
| 100 000 0.625% Commerzbank AG 28/05/2025                                | 102 583          | 0,01              |
| 55 000 0.100% Commerzbank AG 11/09/2025                                 | 54 514           | 0,00              |
| 100 000 2.750% Commerzbank AG 08/12/2025                                | 107 256          | 0,01              |
| 500 000 0.875% Commerzbank AG 22/01/2027                                | 468 168          | 0,02              |
| 100 000 3.000% Commerzbank AG 14/09/2027                                | 101 348          | 0,00              |
| 100 000 4.625% Commerzbank AG 21/03/2028                                | 106 488          | 0,01              |
| 50 000 1.250% Commerzbank AG 09/01/2034                                 | 45 085           | 0,00              |
| 100 000 0.750% Commonwealth Bank of Australia 28/02/2028                | 95 827           | 0,00              |
| 100 000 0.875% Commonwealth Bank of Australia 19/02/2029                | 94 189           | 0,00              |
| 100 000 1.936% Commonwealth Bank of Australia 03/10/2029                | 103 841          | 0,01              |
| 100 000 0.125% Commonwealth Bank of Australia 15/10/2029                | 88 117           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Computershare US Inc 07/10/2031                          | 83 700           | 0,00              |
| 100 000 2.500% Continental AG 27/08/2026                                | 105 432          | 0,01              |
| 100 000 3.625% Continental AG 30/11/2027                                | 107 501          | 0,01              |
| 300 000 0.000% Cooperatieve Rabobank UA 21/06/2027                      | 286 344          | 0,01              |
| 100 000 0.875% Cooperatieve Rabobank UA 08/02/2028                      | 97 804           | 0,00              |
| 100 000 0.875% Cooperatieve Rabobank UA 01/02/2029                      | 95 947           | 0,00              |
| 100 000 0.010% Cooperatieve Rabobank UA 02/07/2030                      | 87 097           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Cooperatieve Rabobank UA 01/12/2031                      | 84 289           | 0,00              |
| 100 000 0.750% Cooperatieve Rabobank UA 02/03/2032                      | 88 826           | 0,00              |
| 100 000 3.875% Cooperatieve Rabobank UA 30/11/2032                      | 103 815          | 0,01              |
| 300 000 2.875% Cooperatieve Rabobank UA 19/01/2033                      | 319 002          | 0,01              |
| 100 000 1.500% Cooperatieve Rabobank UA 26/04/2038                      | 85 885           | 0,00              |
| 100 000 0.010% Cooperatieve Rabobank UA 27/11/2040                      | 61 510           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Corp Andina de Fomento 13/02/2025                        | 102 902          | 0,01              |
| 100 000 0.250% Corp Andina de Fomento 04/02/2026                        | 97 474           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Council Of Europe Development Bank 10/03/2027            | 97 111           | 0,00              |
| 100 000 0.000% Council Of Europe Development Bank 09/04/2027            | 96 315           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 1.000% Council Of Europe Development Bank 13/04/2029            | 97 005           | 0,00              |
| 150 000 0.050% Council Of Europe Development Bank 21/01/2030            | 134 297          | 0,01              |
| 100 000 0.250% Council Of Europe Development Bank 19/01/2032            | 85 939           | 0,00              |
| 100 000 4.750% Covestro AG 15/11/2028                                   | 110 351          | 0,01              |
| 100 000 2.750% CPI Property Group SA 12/05/2026                         | 86 289           | 0,00              |
| 100 000 1.750% CPI Property Group SA 14/01/2030                         | 62 175           | 0,00              |
| 100 000 2.625% Credit Agricole Assurances SA 29/01/2048                 | 94 525           | 0,00              |
| 100 000 0.375% Credit Agricole Home Loan SFH SA 30/09/2024              | 103 883          | 0,01              |
| 100 000 0.500% Credit Agricole Home Loan SFH SA 03/04/2025              | 102 613          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Credit Agricole Home Loan SFH SA 05/05/2027              | 98 388           | 0,00              |
| 100 000 0.875% Credit Agricole Home Loan SFH SA 31/08/2027              | 98 185           | 0,00              |
| 100 000 2.875% Credit Agricole Home Loan SFH SA 23/06/2028              | 106 874          | 0,01              |
| 100 000 0.050% Credit Agricole Home Loan SFH SA 06/12/2029              | 88 301           | 0,00              |
| 100 000 2.125% Credit Agricole Home Loan SFH SA 07/01/2030              | 101 521          | 0,00              |
| 100 000 0.010% Credit Agricole Home Loan SFH SA 03/11/2031              | 82 853           | 0,00              |
| 100 000 3.250% Credit Agricole Home Loan SFH SA 28/09/2032              | 108 662          | 0,01              |
| 100 000 0.375% Credit Agricole Home Loan SFH SA 01/02/2033              | 82 622           | 0,00              |
| 100 000 1.500% Credit Agricole Home Loan SFH SA 03/02/2037              | 86 474           | 0,00              |
| 100 000 1.500% Credit Agricole Home Loan SFH SA 28/09/2038              | 84 438           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Credit Agricole Italia SpA 21/03/2025                    | 103 670          | 0,01              |
| 100 000 1.000% Credit Agricole Italia SpA 25/03/2027                    | 98 875           | 0,00              |
| 100 000 0.750% Credit Agricole Italia SpA 20/01/2042                    | 65 463           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Credit Agricole Italia SpA 17/01/2045                    | 65 063           | 0,00              |
| 200 000 0.500% Credit Agricole Public Sector SCF SA 10/10/2025          | 202 456          | 0,01              |
| 100 000 0.125% Credit Agricole Public Sector SCF SA 08/12/2032          | 83 710           | 0,00              |
| 200 000 1.000% Credit Agricole SA 18/09/2025                            | 204 648          | 0,01              |
| 100 000 4.000% Credit Agricole SA 12/10/2026                            | 108 448          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 2.625% Credit Agricole SA 17/03/2027                            | 102 107          | 0,01              |
| 100 000 3.375% Credit Agricole SA 28/07/2027                            | 106 895          | 0,01              |
| 100 000 0.625% Credit Agricole SA 12/01/2028                            | 94 989           | 0,00              |
| 100 000 0.375% Credit Agricole SA 20/04/2028                            | 90 643           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Credit Agricole SA 24/02/2029                            | 94 080           | 0,00              |
| 100 000 2.000% Credit Agricole SA 25/03/2029                            | 93 899           | 0,00              |
| 100 000 4.250% Credit Agricole SA 11/07/2029                            | 108 896          | 0,01              |
| 100 000 2.500% Credit Agricole SA 29/08/2029                            | 101 861          | 0,00              |
| 100 000 1.625% Credit Agricole SA 05/06/2030                            | 101 032          | 0,00              |
| 100 000 0.875% Credit Agricole SA 14/01/2032                            | 83 651           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Credit Agricole SA 12/07/2032                            | 84 671           | 0,00              |
| 100 000 4.000% Credit Agricole SA 18/01/2033                            | 110 831          | 0,01              |
| 200 000 2.375% Credit Agricole SA/London 20/05/2024                     | 214 094          | 0,01              |
| 100 000 1.375% Credit Agricole SA/London 13/03/2025                     | 103 988          | 0,01              |
| 200 000 1.875% Credit Agricole SA/London 20/12/2026                     | 202 303          | 0,01              |
| 100 000 1.081% Credit Logement SA 15/02/2034                            | 86 989           | 0,00              |
| 100 000 1.250% Credit Mutuel Arkea SA 31/05/2024                        | 105 322          | 0,01              |
| 100 000 0.010% Credit Mutuel Arkea SA 28/01/2026                        | 97 289           | 0,00              |
| 100 000 3.500% Credit Mutuel Arkea SA 09/02/2029                        | 102 028          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Credit Mutuel Arkea SA 18/01/2030                        | 87 046           | 0,00              |
| 100 000 3.375% Credit Mutuel Arkea SA 11/03/2031                        | 97 774           | 0,00              |
| 100 000 4.250% Credit Mutuel Arkea SA 01/12/2032                        | 108 506          | 0,01              |
| 100 000 0.125% Credit Mutuel Home Loan SFH SA 09/04/2025                | 101 742          | 0,00              |
| 100 000 0.625% Credit Mutuel Home Loan SFH SA 04/03/2027                | 98 293           | 0,00              |
| 200 000 2.375% Credit Mutuel Home Loan SFH SA 08/02/2028                | 208 922          | 0,01              |
| 100 000 3.250% Credit Mutuel Home Loan SFH SA 31/10/2029                | 108 656          | 0,01              |
| 200 000 0.125% Credit Mutuel Home Loan SFH SA 28/01/2030                | 176 389          | 0,01              |
| 100 000 0.875% Credit Mutuel Home Loan SFH SA 04/03/2032                | 88 813           | 0,00              |
| 100 000 0.450% Credit Suisse AG/London 19/05/2025                       | 98 324           | 0,00              |
| 100 000 0.250% Credit Suisse AG/London 05/01/2026                       | 96 481           | 0,00              |
| 100 000 1.500% Credit Suisse AG/London 10/04/2026                       | 99 185           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 1.250% Credit Suisse Group AG<br>17/07/2025                     | 101 645          | 0,00              |
| 100 000 2.125% Credit Suisse Group AG<br>13/10/2026                     | 99 002           | 0,00              |
| 200 000 7.750% Credit Suisse Group AG<br>01/03/2029                     | 237 783          | 0,01              |
| 100 000 0.500% CTP NV 21/06/2025  | 95 328           | 0,00              |
| 100 000 0.625% CTP NV 27/09/2026  | 86 159           | 0,00              |
| 100 000 0.750% CTP NV 18/02/2027  | 84 232           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Czech Gas Networks<br>Investments Sarl 16/07/2027        | 92 591           | 0,00              |
| 100 000 1.601% DAA Finance PLC 05/11/2032                               | 86 752           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Danfoss Finance I BV<br>28/04/2026                       | 97 081           | 0,00              |
| 100 000 0.250% Danmarks Skibskredit A/S<br>21/06/2028                   | 92 242           | 0,00              |
| 100 000 0.520% Danone SA 09/11/2030                                     | 88 212           | 0,00              |
| 100 000 0.625% Danske Bank A/S 26/05/2025                               | 101 517          | 0,00              |
| 100 000 1.375% Danske Bank A/S 17/02/2027                               | 99 548           | 0,00              |
| 200 000 2.500% Danske Bank A/S 21/06/2029                               | 209 450          | 0,01              |
| 100 000 0.125% Dassault Systemes SE<br>16/09/2026                       | 97 267           | 0,00              |
| 100 000 0.300% DekaBank Deutsche<br>Girozentrale 20/11/2026             | 96 722           | 0,00              |
| 100 000 1.625% Dell Bank International DAC<br>24/06/2024                | 105 618          | 0,01              |
| 100 000 0.500% Dell Bank International DAC<br>27/10/2026                | 96 462           | 0,00              |
| 100 000 4.500% Dell Bank International DAC<br>18/10/2027                | 110 933          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Deutsche Apotheker-und<br>Aerztebank eG 05/07/2028       | 96 382           | 0,00              |
| 100 000 0.010% Deutsche Apotheker-und<br>Aerztebank eG 06/02/2029       | 90 955           | 0,00              |
| 100 000 0.050% Deutsche Apotheker-und<br>Aerztebank eG 13/11/2029       | 89 088           | 0,00              |
| 200 000 0.750% Deutsche Bahn Finance GMBH<br>02/03/2026                 | 203 644          | 0,01              |
| 350 000 1.125% Deutsche Bahn Finance GMBH<br>18/12/2028                 | 340 791          | 0,01              |
| 100 000 1.875% Deutsche Bahn Finance GMBH<br>24/05/2030                 | 99 294           | 0,00              |
| 100 000 1.625% Deutsche Bahn Finance GMBH<br>16/08/2033                 | 91 353           | 0,00              |
| 100 000 0.875% Deutsche Bahn Finance GMBH<br>23/06/2039                 | 73 668           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Deutsche Bahn Finance GMBH<br>16/04/2040                 | 77 010           | 0,00              |
| 50 000 3.875% Deutsche Bahn Finance GMBH<br>13/10/2042                  | 55 000           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 0.625% Deutsche Bahn Finance GMBH<br>08/12/2050                 | 55 316           | 0,00              |
| 115 000 1.125% Deutsche Bahn Finance GMBH<br>29/05/2051                 | 71 344           | 0,00              |
| 100 000 1.600% Deutsche Bahn Finance GMBH<br>(Perpetual)                | 86 599           | 0,00              |
| 200 000 0.625% Deutsche Bank AG 21/08/2025                              | 203 898          | 0,01              |
| 100 000 2.250% Deutsche Bank AG 20/09/2027                              | 104 646          | 0,01              |
| 100 000 4.000% Deutsche Bank AG 29/11/2027                              | 106 698          | 0,01              |
| 100 000 1.750% Deutsche Bank AG 17/01/2028                              | 91 113           | 0,00              |
| 100 000 3.000% Deutsche Bank AG 28/03/2028                              | 107 995          | 0,01              |
| 100 000 5.375% Deutsche Bank AG 11/01/2029                              | 106 110          | 0,01              |
| 100 000 3.000% Deutsche Bank AG 18/07/2030                              | 107 746          | 0,01              |
| 100 000 5.000% Deutsche Bank AG 05/09/2030                              | 103 707          | 0,01              |
| 100 000 4.000% Deutsche Bank AG 24/06/2032                              | 94 164           | 0,00              |
| 100 000 2.500% Deutsche Bank AG 20/09/2032                              | 103 427          | 0,01              |
| 200 000 2.625% Deutsche Bank AG 30/06/2037                              | 203 759          | 0,01              |
| 100 000 0.000% Deutsche Boerse AG<br>22/02/2026                         | 99 069           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Deutsche Boerse AG<br>22/02/2031                         | 84 892           | 0,00              |
| 120 000 0.010% Deutsche Kreditbank AG<br>23/02/2026                     | 116 261          | 0,01              |
| 100 000 0.010% Deutsche Kreditbank AG<br>07/11/2029                     | 89 173           | 0,00              |
| 100 000 0.100% Deutsche Pfandbriefbank AG<br>02/02/2026                 | 91 994           | 0,00              |
| 100 000 0.010% Deutsche Pfandbriefbank AG<br>25/08/2026                 | 97 594           | 0,00              |
| 100 000 4.375% Deutsche Pfandbriefbank AG<br>28/08/2026                 | 104 652          | 0,01              |
| 100 000 1.750% Deutsche Pfandbriefbank AG<br>01/03/2027                 | 102 854          | 0,01              |
| 100 000 0.625% Deutsche Pfandbriefbank AG<br>30/08/2027                 | 97 367           | 0,00              |
| 50 000 1.250% Deutsche Pfandbriefbank AG<br>20/04/2035                  | 43 856           | 0,00              |
| 200 000 1.625% Deutsche Post AG 05/12/2028                              | 200 374          | 0,01              |
| 150 000 0.875% Deutsche Telekom AG<br>25/03/2026                        | 152 782          | 0,01              |
| 200 000 1.750% Deutsche Telekom AG<br>25/03/2031                        | 193 490          | 0,01              |
| 200 000 1.375% Deutsche Telekom AG<br>05/07/2034                        | 174 462          | 0,01              |
| 50 000 1.500% Deutsche Telekom International<br>Finance BV 03/04/2028   | 49 632           | 0,00              |
| 150 000 2.000% Deutsche Telekom International<br>Finance BV 01/12/2029  | 149 836          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   | <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 0.000% Dexia Credit Local SA 29/05/2024                         | 104 463          | 0,01              | 100 000 0.250% E.ON SE 24/10/2026                                       | 97 755           | 0,00              |
| 100 000 1.250% Dexia Credit Local SA 26/11/2024                         | 105 014          | 0,01              | 100 000 0.375% E.ON SE 29/09/2027                                       | 95 782           | 0,00              |
| 200 000 1.000% Dexia Credit Local SA 18/10/2027                         | 197 903          | 0,01              | 100 000 3.500% E.ON SE 12/01/2028                                       | 108 987          | 0,01              |
| 200 000 0.000% Dexia Credit Local SA 21/01/2028                         | 187 224          | 0,01              | 100 000 0.100% E.ON SE 19/12/2028                                       | 89 315           | 0,00              |
| 100 000 0.450% DH Europe Finance II Sarl 18/03/2028                     | 93 992           | 0,00              | 50 000 1.625% E.ON SE 29/03/2031  | 46 952           | 0,00              |
| 100 000 0.750% DH Europe Finance II Sarl 18/09/2031                     | 86 601           | 0,00              | 100 000 0.875% E.ON SE 20/08/2031                                       | 87 140           | 0,00              |
| 100 000 1.350% DH Europe Finance II Sarl 18/09/2039                     | 74 818           | 0,00              | 100 000 0.600% E.ON SE 01/10/2032                                       | 82 342           | 0,00              |
| 100 000 1.875% Diageo Capital BV 08/06/2034                             | 91 796           | 0,00              | 40 000 0.875% E.ON SE 18/10/2034  | 31 725           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Diageo Finance PLC 22/04/2025                            | 103 638          | 0,01              | 40 000 3.875% E.ON SE 12/01/2035  | 43 122           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Digital Dutch Finco BV 15/01/2032                        | 76 312           | 0,00              | 100 000 2.614% East Japan Railway Co 08/09/2025                         | 106 662          | 0,01              |
| 100 000 1.125% Digital Euro Finco LLC 09/04/2028                        | 88 985           | 0,00              | 100 000 3.245% East Japan Railway Co 08/09/2030                         | 106 231          | 0,01              |
| 100 000 1.375% Digital Intrepid Holding BV 18/07/2032                   | 76 431           | 0,00              | 100 000 1.875% easyJet FinCo BV 03/03/2028                              | 94 960           | 0,00              |
| 200 000 0.250% DNB Bank ASA 09/04/2024                                  | 209 733          | 0,01              | 100 000 0.750% Eaton Capital UnLtd Co 20/09/2024                        | 104 453          | 0,01              |
| 100 000 3.125% DNB Bank ASA 21/09/2027                                  | 106 810          | 0,01              | 100 000 0.128% Eaton Capital UnLtd Co 08/03/2026                        | 98 088           | 0,00              |
| 100 000 0.375% DNB Bank ASA 18/01/2028                                  | 96 429           | 0,00              | 100 000 0.577% Eaton Capital UnLtd Co 08/03/2030                        | 88 887           | 0,00              |
| 100 000 0.625% DNB Boligkredit AS 19/06/2025                            | 102 354          | 0,01              | 100 000 2.000% EDP Finance BV 22/04/2025                                | 106 002          | 0,01              |
| 100 000 1.250% Dover Corp 09/11/2026                                    | 100 302          | 0,00              | 100 000 1.500% EDP Finance BV 22/11/2027                                | 98 925           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Dow Chemical Co 15/03/2027                               | 94 926           | 0,00              | 100 000 1.875% EDP Finance BV 21/09/2029                                | 96 466           | 0,00              |
| 100 000 2.375% DP World Ltd/United Arab Emirates 25/09/2026             | 102 527          | 0,01              | 100 000 0.500% Eika Boligkredit AS 28/08/2025                           | 101 510          | 0,00              |
| 100 000 0.375% DSV A/S 26/02/2027                                       | 97 103           | 0,00              | 100 000 4.000% Electricite de France SA 12/11/2025                      | 109 737          | 0,01              |
| 100 000 3.850% Duke Energy Corp 15/06/2034                              | 101 723          | 0,00              | 100 000 1.000% Electricite de France SA 13/10/2026                      | 100 285          | 0,00              |
| 100 000 0.450% DXC Capital Funding DAC 15/09/2027                       | 88 823           | 0,00              | 100 000 4.125% Electricite de France SA 25/03/2027                      | 110 482          | 0,01              |
| 100 000 0.950% DXC Capital Funding DAC 15/09/2031                       | 77 766           | 0,00              | 100 000 1.000% Electricite de France SA 29/11/2033                      | 77 935           | 0,00              |
| 200 000 1.125% DZ HYP AG 18/09/2024                                     | 210 206          | 0,01              | 100 000 4.750% Electricite de France SA 12/10/2034                      | 109 688          | 0,01              |
| 200 000 0.010% DZ HYP AG 12/09/2025                                     | 200 765          | 0,01              | 100 000 1.875% Electricite de France SA 13/10/2036                      | 80 745           | 0,00              |
| 50 000 0.500% DZ HYP AG 13/11/2025                                      | 50 605           | 0,00              | 100 000 2.000% Electricite de France SA 09/12/2049                      | 65 864           | 0,00              |
| 100 000 0.010% DZ HYP AG 26/10/2026                                     | 97 082           | 0,00              | 100 000 1.375% Eli Lilly & Co 14/09/2061                                | 55 149           | 0,00              |
| 150 000 0.010% DZ HYP AG 23/06/2028                                     | 139 008          | 0,01              | 100 000 1.375% Elia Transmission Belgium SA 27/05/2024                  | 106 132          | 0,01              |
| 100 000 0.010% DZ HYP AG 27/10/2028                                     | 91 744           | 0,00              | 200 000 2.600% ELM BV for Swiss Reinsurance Co Ltd (Perpetual)          | 197 836          | 0,01              |
| 100 000 0.875% DZ HYP AG 30/01/2029                                     | 96 038           | 0,00              | 100 000 2.875% ELO SACA 29/01/2026                                      | 102 784          | 0,01              |
| 150 000 0.050% DZ HYP AG 29/06/2029                                     | 135 274          | 0,01              | 100 000 4.875% ELO SACA 08/12/2028                                      | 103 709          | 0,01              |
| 100 000 0.010% DZ HYP AG 15/11/2030                                     | 86 254           | 0,00              | 150 000 1.250% Emerson Electric Co 15/10/2025                           | 154 289          | 0,01              |
| 100 000 0.000% E.ON SE 28/08/2024                                       | 103 477          | 0,01              |   |                  |                   |
| 55 000 0.125% E.ON SE 18/01/2026  | 54 631           | 0,00              |   |                  |                   |



## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 2.750% Emirates Telecommunications Group Co PJSC 18/06/2026     | 104 896          | 0,01              |
| 200 000 0.875% Emirates Telecommunications Group Co PJSC 17/05/2033     | 161 855          | 0,01              |
| 100 000 0.625% EnBW International Finance BV 17/04/2025                 | 103 099          | 0,01              |
| 50 000 2.500% EnBW International Finance BV 04/06/2026                  | 53 508           | 0,00              |
| 100 000 3.625% EnBW International Finance BV 22/11/2026                 | 109 462          | 0,01              |
| 100 000 0.125% EnBW International Finance BV 01/03/2028                 | 94 267           | 0,00              |
| 100 000 4.049% EnBW International Finance BV 22/11/2029                 | 110 705          | 0,01              |
| 100 000 0.250% EnBW International Finance BV 19/10/2030                 | 83 772           | 0,00              |
| 50 000 0.500% EnBW International Finance BV 01/03/2033                  | 39 351           | 0,00              |
| 100 000 0.000% Enel Finance International NV 17/06/2024                 | 104 210          | 0,01              |
| 200 000 1.966% Enel Finance International NV 27/01/2025                 | 211 695          | 0,01              |
| 100 000 0.250% Enel Finance International NV 17/11/2025                 | 100 091          | 0,00              |
| 100 000 0.000% Enel Finance International NV 28/05/2026                 | 97 149           | 0,00              |
| 100 000 0.000% Enel Finance International NV 17/06/2027                 | 92 877           | 0,00              |
| 100 000 3.875% Enel Finance International NV 09/03/2029                 | 109 134          | 0,01              |
| 100 000 0.500% Enel Finance International NV 17/06/2030                 | 85 265           | 0,00              |
| 100 000 1.250% Enel Finance International NV 17/01/2035                 | 78 510           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Enel SpA (Perpetual)                                     | 87 685           | 0,00              |
| 50 000 6.125% e-netz Suedhessen AG 23/04/2041                           | 69 231           | 0,00              |
| 100 000 0.875% Enexis Holding NV 28/04/2026                             | 100 873          | 0,00              |
| 100 000 0.375% Enexis Holding NV 14/04/2033                             | 80 807           | 0,00              |
| 100 000 0.000% Engie SA 04/03/2027                                      | 94 813           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Engie SA 22/06/2028                                      | 97 738           | 0,00              |
| 100 000 3.625% Engie SA 11/01/2030                                      | 108 203          | 0,01              |
| 100 000 2.125% Engie SA 30/03/2032                                      | 95 509           | 0,00              |
| 100 000 4.000% Engie SA 11/01/2035                                      | 108 106          | 0,01              |
| 100 000 1.500% Engie SA 13/03/2035                                      | 82 891           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Engie SA 26/10/2036                                      | 74 817           | 0,00              |
| 100 000 1.500% Engie SA (Perpetual)                                     | 87 794           | 0,00              |
| 100 000 1.625% Engie SA (Perpetual)                                     | 99 999           | 0,00              |
| 100 000 3.250% Engie SA (Perpetual)                                     | 105 000          | 0,01              |

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>                                  |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 200 000 0.625% Eni SpA 19/09/2024  | 208 970          | 0,01              |
| 100 000 0.375% Eni SpA 14/06/2028  | 92 073           | 0,00              |
| 100 000 3.625% Eni SpA 29/01/2029  | 108 773          | 0,01              |
| 100 000 2.000% Eni SpA (Perpetual)   | 91 577           | 0,00              |
| 200 000 2.750% Eni SpA (Perpetual)   | 167 978          | 0,01              |
| 100 000 1.698% EP Infrastructure AS 30/07/2026   | 89 991           | 0,00              |
| 100 000 0.250% Equinix Inc 15/03/2027  | 93 694           | 0,00              |
| 100 000 0.750% Equinor ASA 22/05/2026  | 100 011          | 0,00              |
| 100 000 0.750% Equinor ASA 09/11/2026  | 98 717           | 0,00              |
| 300 000 1.375% Equinor ASA 22/05/2032  | 271 331          | 0,01              |
| 100 000 1.625% Equinor ASA 17/02/2035  | 87 412           | 0,00              |
| 100 000 2.750% Erdoel-Lagergesellschaft mbH 20/03/2028   | 105 785          | 0,01              |
| 100 000 0.500% ERG SpA 11/09/2027  | 93 689           | 0,00              |
| 100 000 0.625% Erste Group Bank AG 17/04/2026  | 100 140          | 0,00              |
| 100 000 0.625% Erste Group Bank AG 18/01/2027  | 98 460           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Erste Group Bank AG 17/05/2028  | 88 625           | 0,00              |
| 100 000 0.100% Erste Group Bank AG 16/11/2028  | 92 293           | 0,00              |
| 100 000 0.100% Erste Group Bank AG 15/01/2030  | 88 186           | 0,00              |
| 100 000 2.500% Erste Group Bank AG 19/09/2030  | 103 467          | 0,01              |
| 100 000 4.000% Erste Group Bank AG 16/01/2031  | 106 907          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Erste&Steiermaerkische Banka dd 06/07/2028  | 89 481           | 0,00              |
| 100 000 1.125% ESB Finance DAC 11/06/2030  | 92 735           | 0,00              |
| 200 000 4.000% ESB Finance DAC 03/05/2032  | 222 844          | 0,01              |
| 100 000 2.125% ESB Finance DAC 05/11/2033  | 94 439           | 0,00              |
| 100 000 3.750% ESB Finance DAC 25/01/2043  | 103 703          | 0,01              |
| 100 000 0.125% EssilorLuxottica SA 27/05/2025  | 101 406          | 0,00              |
| 100 000 0.375% EssilorLuxottica SA 27/11/2027  | 95 223           | 0,00              |
| 100 000 3.000% Essity Capital BV 21/09/2026  | 106 696          | 0,01              |
| 100 000 0.250% Essity Capital BV 15/09/2029  | 87 245           | 0,00              |
| 100 000 2.625% Euroclear Investments SA 11/04/2048   | 96 479           | 0,00              |
| 100 000 0.100% Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 20/05/2030 | 88 149           | 0,00              |
| 200 000 0.150% Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 10/10/2034 | 154 945          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 3.750% Eurofins Scientific SE 17/07/2026                        | 106 396          | 0,01              |
| 100 000 0.875% Eurofins Scientific SE 19/05/2031                        | 80 319           | 0,00              |
| 100 000 3.279% Eurogrid GmbH 05/09/2031                                 | 106 622          | 0,01              |
| 100 000 1.375% Euronet Worldwide Inc 22/05/2026                         | 97 065           | 0,00              |
| 100 000 0.000% European Financial Stability Facility 19/04/2024         | 105 173          | 0,01              |
| 350 000 0.400% European Financial Stability Facility 17/02/2025         | 361 895          | 0,01              |
| 200 000 0.500% European Financial Stability Facility 11/07/2025         | 205 211          | 0,01              |
| 200 000 0.000% European Financial Stability Facility 15/10/2025         | 201 532          | 0,01              |
| 200 000 1.500% European Financial Stability Facility 15/12/2025         | 208 907          | 0,01              |
| 400 000 0.400% European Financial Stability Facility 26/01/2026         | 404 342          | 0,02              |
| 100 000 0.400% European Financial Stability Facility 31/05/2026         | 100 321          | 0,00              |
| 200 000 0.000% European Financial Stability Facility 20/07/2026         | 197 232          | 0,01              |
| 300 000 2.750% European Financial Stability Facility 17/08/2026         | 323 461          | 0,01              |
| 200 000 0.625% European Financial Stability Facility 16/10/2026         | 200 365          | 0,01              |
| 300 000 0.750% European Financial Stability Facility 03/05/2027         | 298 912          | 0,01              |
| 200 000 0.875% European Financial Stability Facility 26/07/2027         | 199 320          | 0,01              |
| 450 000 0.000% European Financial Stability Facility 13/10/2027         | 428 166          | 0,02              |
| 300 000 0.950% European Financial Stability Facility 14/02/2028         | 296 558          | 0,01              |
| 200 000 2.375% European Financial Stability Facility 11/04/2028         | 211 438          | 0,01              |
| 200 000 0.875% European Financial Stability Facility 05/09/2028         | 194 900          | 0,01              |
| 200 000 0.050% European Financial Stability Facility 17/10/2029         | 180 385          | 0,01              |
| 150 000 0.125% European Financial Stability Facility 18/03/2030         | 134 389          | 0,01              |
| 300 000 0.000% European Financial Stability Facility 20/01/2031         | 259 640          | 0,01              |
| 200 000 2.375% European Financial Stability Facility 21/06/2032         | 206 147          | 0,01              |
| 400 000 2.875% European Financial Stability Facility 16/02/2033         | 429 182          | 0,02              |
| 300 000 1.250% European Financial Stability Facility 24/05/2033         | 275 646          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 300 000 0.875% European Financial Stability Facility 10/04/2035         | 252 055          | 0,01              |
| 150 000 1.450% European Financial Stability Facility 05/09/2040         | 124 778          | 0,01              |
| 200 000 1.700% European Financial Stability Facility 13/02/2043         | 168 741          | 0,01              |
| 100 000 2.350% European Financial Stability Facility 29/07/2044         | 94 801           | 0,00              |
| 200 000 1.200% European Financial Stability Facility 17/02/2045         | 150 000          | 0,01              |
| 370 000 1.375% European Financial Stability Facility 31/05/2047         | 281 535          | 0,01              |
| 150 000 1.800% European Financial Stability Facility 10/07/2048         | 122 424          | 0,01              |
| 350 000 0.700% European Financial Stability Facility 20/01/2050         | 209 237          | 0,01              |
| 100 000 0.050% European Financial Stability Facility 18/01/2052         | 44 180           | 0,00              |
| 100 000 0.700% European Financial Stability Facility 17/01/2053         | 56 315           | 0,00              |
| 100 000 1.750% European Financial Stability Facility 17/07/2053         | 77 231           | 0,00              |
| 150 000 0.050% European Investment Bank 24/05/2024                      | 157 326          | 0,01              |
| 150 000 0.200% European Investment Bank 15/07/2024                      | 156 977          | 0,01              |
| 100 000 0.875% European Investment Bank 13/09/2024                      | 105 184          | 0,01              |
| 400 000 0.250% European Investment Bank 14/10/2024                      | 416 510          | 0,02              |
| 200 000 0.000% European Investment Bank 25/03/2025                      | 204 570          | 0,01              |
| 100 000 0.125% European Investment Bank 15/04/2025                      | 102 435          | 0,01              |
| 300 000 0.375% European Investment Bank 16/07/2025                      | 307 096          | 0,01              |
| 200 000 2.750% European Investment Bank 15/09/2025                      | 215 856          | 0,01              |
| 200 000 4.500% European Investment Bank 15/10/2025                      | 224 926          | 0,01              |
| 100 000 0.000% European Investment Bank 13/03/2026                      | 99 684           | 0,00              |
| 50 000 0.375% European Investment Bank 14/04/2026                       | 50 269           | 0,00              |
| 50 000 0.375% European Investment Bank 15/05/2026                       | 50 213           | 0,00              |
| 200 000 0.100% European Investment Bank 15/10/2026                      | 196 984          | 0,01              |
| 200 000 0.000% European Investment Bank 22/12/2026                      | 195 192          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 200 000 0.500% European Investment Bank 15/01/2027                      | 198 610          | 0,01              |
| 200 000 3.500% European Investment Bank 15/04/2027                      | 221 770          | 0,01              |
| 200 000 0.000% European Investment Bank 17/06/2027                      | 192 336          | 0,01              |
| 150 000 0.375% European Investment Bank 15/09/2027                      | 145 902          | 0,01              |
| 250 000 0.875% European Investment Bank 14/01/2028                      | 247 480          | 0,01              |
| 150 000 0.000% European Investment Bank 28/03/2028                      | 141 131          | 0,01              |
| 300 000 0.000% European Investment Bank 15/05/2028                      | 281 096          | 0,01              |
| 100 000 2.750% European Investment Bank 28/07/2028                      | 107 944          | 0,01              |
| 200 000 0.000% European Investment Bank 28/09/2028                      | 185 650          | 0,01              |
| 250 000 0.625% European Investment Bank 22/01/2029                      | 238 747          | 0,01              |
| 200 000 0.125% European Investment Bank 20/06/2029                      | 183 460          | 0,01              |
| 50 000 0.250% European Investment Bank 14/09/2029                       | 45 945           | 0,00              |
| 100 000 0.050% European Investment Bank 15/11/2029                      | 90 241           | 0,00              |
| 300 000 0.050% European Investment Bank 16/01/2030                      | 269 232          | 0,01              |
| 200 000 2.250% European Investment Bank 15/03/2030                      | 208 207          | 0,01              |
| 50 000 4.000% European Investment Bank 15/04/2030                       | 58 010           | 0,00              |
| 200 000 0.000% European Investment Bank 09/09/2030                      | 175 399          | 0,01              |
| 100 000 0.010% European Investment Bank 15/11/2030                      | 87 157           | 0,00              |
| 550 000 0.000% European Investment Bank 14/01/2031                      | 476 251          | 0,02              |
| 200 000 1.000% European Investment Bank 14/03/2031                      | 187 576          | 0,01              |
| 500 000 0.250% European Investment Bank 20/01/2032                      | 430 191          | 0,02              |
| 250 000 1.000% European Investment Bank 14/04/2032                      | 229 409          | 0,01              |
| 250 000 1.500% European Investment Bank 15/06/2032                      | 239 872          | 0,01              |
| 200 000 1.125% European Investment Bank 13/04/2033                      | 182 076          | 0,01              |
| 100 000 3.000% European Investment Bank 14/10/2033                      | 108 281          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 150 000 0.050% European Investment Bank 13/10/2034                      | 115 505          | 0,01              |
| 50 000 2.625% European Investment Bank 15/03/2035                       | 51 567           | 0,00              |
| 200 000 0.010% European Investment Bank 15/11/2035                      | 147 081          | 0,01              |
| 200 000 0.200% European Investment Bank 17/03/2036                      | 149 561          | 0,01              |
| 50 000 1.125% European Investment Bank 15/09/2036                       | 42 284           | 0,00              |
| 50 000 4.000% European Investment Bank 15/10/2037                       | 59 109           | 0,00              |
| 99 000 0.500% European Investment Bank 13/11/2037                       | 74 230           | 0,00              |
| 200 000 0.250% European Investment Bank 15/06/2040                      | 132 451          | 0,01              |
| 100 000 0.010% European Investment Bank 15/05/2041                      | 61 152           | 0,00              |
| 100 000 1.000% European Investment Bank 14/11/2042                      | 73 495           | 0,00              |
| 150 000 1.750% European Investment Bank 15/09/2045                      | 125 348          | 0,01              |
| 50 000 0.875% European Investment Bank 13/09/2047                       | 33 389           | 0,00              |
| 50 000 1.500% European Investment Bank 15/11/2047                       | 38 915           | 0,00              |
| 50 000 1.500% European Investment Bank 16/10/2048                       | 38 193           | 0,00              |
| 100 000 0.050% European Investment Bank 27/01/2051                      | 45 483           | 0,00              |
| 200 000 0.125% European Stability Mechanism 22/04/2024                  | 210 471          | 0,01              |
| 100 000 0.000% European Stability Mechanism 16/12/2024                  | 103 144          | 0,01              |
| 150 000 0.000% European Stability Mechanism 14/03/2025                  | 153 652          | 0,01              |
| 250 000 1.000% European Stability Mechanism 23/09/2025                  | 258 754          | 0,01              |
| 100 000 0.500% European Stability Mechanism 02/03/2026                  | 101 127          | 0,00              |
| 200 000 0.000% European Stability Mechanism 15/12/2026                  | 195 089          | 0,01              |
| 200 000 0.750% European Stability Mechanism 15/03/2027                  | 199 685          | 0,01              |
| 250 000 1.000% European Stability Mechanism 23/06/2027                  | 250 440          | 0,01              |
| 150 000 3.000% European Stability Mechanism 15/03/2028                  | 163 427          | 0,01              |
| 250 000 0.750% European Stability Mechanism 05/09/2028                  | 242 118          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 400 000 0.010% European Stability Mechanism 04/03/2030                  | 355 343          | 0,01              |
| 300 000 0.010% European Stability Mechanism 15/10/2031                  | 254 337          | 0,01              |
| 350 000 1.200% European Stability Mechanism 23/05/2033                  | 320 184          | 0,01              |
| 100 000 0.875% European Stability Mechanism 18/07/2042                  | 70 909           | 0,00              |
| 200 000 1.800% European Stability Mechanism 02/11/2046                  | 167 213          | 0,01              |
| 50 000 1.850% European Stability Mechanism 01/12/2055                   | 39 194           | 0,00              |
| 200 000 0.500% European Union 04/04/2025                                | 206 588          | 0,01              |
| 400 000 0.800% European Union 04/07/2025                                | 413 929          | 0,02              |
| 300 000 0.000% European Union 04/11/2025                                | 302 269          | 0,01              |
| 600 000 0.000% European Union 04/03/2026                                | 599 010          | 0,02              |
| 700 000 0.000% European Union 06/07/2026                                | 692 578          | 0,03              |
| 200 000 3.000% European Union 04/09/2026                                | 217 575          | 0,01              |
| 300 000 0.250% European Union 22/10/2026                                | 296 601          | 0,01              |
| 450 000 2.000% European Union 04/10/2027                                | 470 495          | 0,02              |
| 100 000 2.875% European Union 04/04/2028                                | 108 461          | 0,01              |
| 400 000 0.000% European Union 02/06/2028                                | 374 686          | 0,02              |
| 700 000 0.000% European Union 04/10/2028                                | 649 715          | 0,03              |
| 500 000 0.000% European Union 04/07/2029                                | 454 000          | 0,02              |
| 400 000 1.625% European Union 04/12/2029                                | 400 670          | 0,02              |
| 700 000 0.000% European Union 04/10/2030                                | 613 256          | 0,02              |
| 100 000 0.750% European Union 04/04/2031                                | 91 935           | 0,00              |
| 300 000 0.000% European Union 22/04/2031                                | 258 388          | 0,01              |
| 900 000 0.000% European Union 04/07/2031                                | 770 236          | 0,03              |
| 100 000 3.375% European Union 04/04/2032                                | 112 011          | 0,01              |
| 600 000 1.000% European Union 06/07/2032                                | 549 253          | 0,02              |
| 250 000 2.750% European Union 04/02/2033                                | 265 724          | 0,01              |
| 250 000 1.250% European Union 04/04/2033                                | 229 752          | 0,01              |
| 400 000 0.000% European Union 04/07/2035                                | 297 605          | 0,01              |
| 350 000 0.250% European Union 22/04/2036                                | 263 530          | 0,01              |
| 350 000 0.200% European Union 04/06/2036                                | 258 609          | 0,01              |
| 700 000 0.400% European Union 04/02/2037                                | 524 694          | 0,02              |
| 200 000 1.125% European Union 04/06/2037                                | 165 414          | 0,01              |
| 300 000 2.750% European Union 04/12/2037                                | 308 673          | 0,01              |
| 500 000 0.100% European Union 04/10/2040                                | 316 456          | 0,01              |
| 300 000 0.450% European Union 04/07/2041                                | 199 479          | 0,01              |
| 50 000 3.750% European Union 04/04/2042                                 | 57 694           | 0,00              |
| 300 000 3.375% European Union 04/11/2042                                | 328 464          | 0,01              |
| 300 000 1.250% European Union 04/02/2043                                | 229 739          | 0,01              |
| 200 000 0.450% European Union 02/05/2046                                | 120 266          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 250 000 0.750% European Union 04/01/2047                                | 161 082          | 0,01              |
| 200 000 2.625% European Union 04/02/2048                                | 193 208          | 0,01              |
| 450 000 0.300% European Union 04/11/2050                                | 230 933          | 0,01              |
| 500 000 0.700% European Union 06/07/2051                                | 292 858          | 0,01              |
| 300 000 2.500% European Union 04/10/2052                                | 278 091          | 0,01              |
| 450 000 3.000% European Union 04/03/2053                                | 460 502          | 0,02              |
| 100 000 1.500% Eutelsat SA 13/10/2028                                   | 84 159           | 0,00              |
| 100 000 0.625% Evonik Industries AG 18/09/2025                          | 100 830          | 0,00              |
| 100 000 0.375% EWE AG 22/10/2032  | 78 845           | 0,00              |
| 100 000 0.524% Exxon Mobil Corp 26/06/2028                              | 93 435           | 0,00              |
| 200 000 0.835% Exxon Mobil Corp 26/06/2032                              | 169 569          | 0,01              |
| 100 000 1.408% Exxon Mobil Corp 26/06/2039                              | 72 711           | 0,00              |
| 100 000 2.750% Fairfax Financial Holdings Ltd 29/03/2028                | 96 756           | 0,00              |
| 100 000 0.000% FCA Bank SpA/Ireland 16/04/2024                          | 104 409          | 0,01              |
| 100 000 2.629% FCC Aqualia SA 08/06/2027                                | 101 778          | 0,00              |
| 100 000 0.250% Federation des Caisses Desjardins du Quebec 08/02/2027   | 96 387           | 0,00              |
| 100 000 0.450% FedEx Corp 05/08/2025                                    | 101 404          | 0,00              |
| 100 000 0.450% FedEx Corp 04/05/2029                                    | 87 590           | 0,00              |
| 110 000 0.950% FedEx Corp 04/05/2033                                    | 86 839           | 0,00              |
| 100 000 3.750% Ferrovie dello Stato Italiane SpA 14/04/2027             | 108 078          | 0,01              |
| 100 000 0.375% Ferrovie dello Stato Italiane SpA 25/03/2028             | 91 377           | 0,00              |
| 100 000 0.625% Fidelity National Information Services Inc 03/12/2025    | 99 981           | 0,00              |
| 100 000 1.500% Fidelity National Information Services Inc 21/05/2027    | 98 966           | 0,00              |
| 100 000 0.000% Finnvera Oyj 15/09/2027                                  | 95 047           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Firmenich Productions Participations SAS 30/10/2026      | 100 560          | 0,00              |
| 100 000 0.125% First Abu Dhabi Bank PJSC 16/02/2026                     | 97 511           | 0,00              |
| 100 000 1.625% First Abu Dhabi Bank PJSC 07/04/2027                     | 99 453           | 0,00              |
| 100 000 1.625% Fiserv Inc 01/07/2030                                    | 91 404           | 0,00              |
| 100 000 1.750% FLUVIUS System Operator CVBA 04/12/2026                  | 99 607           | 0,00              |
| 100 000 0.250% FLUVIUS System Operator CVBA 14/06/2028                  | 91 281           | 0,00              |
| 100 000 0.625% FLUVIUS System Operator CVBA 24/11/2031                  | 84 944           | 0,00              |
| 100 000 4.000% FLUVIUS System Operator CVBA 06/07/2032                  | 111 960          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 0.000% Fresenius Finance Ireland PLC 01/10/2025                 | 99 035           | 0,00              |
| 50 000 0.500% Fresenius Finance Ireland PLC 01/10/2028                  | 44 570           | 0,00              |
| 100 000 1.500% Fresenius Medical Care AG & Co KGaA 29/05/2030           | 88 703           | 0,00              |
| 100 000 4.250% Fresenius SE & Co KGaA 28/05/2026                        | 109 328          | 0,01              |
| 100 000 5.000% Fresenius SE & Co KGaA 28/11/2029                        | 110 954          | 0,01              |
| 100 000 2.000% Gecina SA 30/06/2032                                     | 90 519           | 0,00              |
| 100 000 0.875% General Electric Co 17/05/2025                           | 102 651          | 0,01              |
| 200 000 2.125% General Electric Co 17/05/2037                           | 170 794          | 0,01              |
| 100 000 1.694% General Motors Financial Co Inc 26/03/2025               | 104 136          | 0,01              |
| 100 000 1.375% GlaxoSmithKline Capital PLC 12/09/2029                   | 96 724           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Glencore Capital Finance DAC 10/03/2028                  | 93 498           | 0,00              |
| 100 000 0.750% Glencore Capital Finance DAC 01/03/2029                  | 87 922           | 0,00              |
| 100 000 1.250% Glencore Capital Finance DAC 01/03/2033                  | 79 060           | 0,00              |
| 100 000 0.625% Glencore Finance Europe Ltd 11/09/2024                   | 103 800          | 0,01              |
| 100 000 2.250% Global Switch Holdings Ltd 31/05/2027                    | 101 999          | 0,01              |
| 100 000 3.000% Globalworth Real Estate Investments Ltd 29/03/2025       | 94 444           | 0,00              |
| 300 000 1.375% Goldman Sachs Group Inc 15/05/2024                       | 317 839          | 0,01              |
| 150 000 0.250% Goldman Sachs Group Inc 26/01/2028                       | 136 081          | 0,01              |
| 50 000 2.000% Goldman Sachs Group Inc 01/11/2028                        | 49 049           | 0,00              |
| 200 000 1.250% Goldman Sachs Group Inc 07/02/2029                       | 184 901          | 0,01              |
| 200 000 0.875% Goldman Sachs Group Inc 09/05/2029                       | 178 832          | 0,01              |
| 105 000 4.000% Goldman Sachs Group Inc 21/09/2029                       | 112 593          | 0,01              |
| 50 000 0.875% Goldman Sachs Group Inc 21/01/2030                        | 43 625           | 0,00              |
| 50 000 3.000% Goldman Sachs Group Inc 12/02/2031                        | 50 158           | 0,00              |
| 60 000 0.750% Goldman Sachs Group Inc 23/03/2032                        | 47 976           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Grand City Properties SA 03/08/2026                      | 89 808           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Grand City Properties SA 11/01/2028                      | 76 692           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 50 000 0.625% Grenke Finance PLC 09/01/2025                             | 48 344           | 0,00              |
| 100 000 3.125% GSK Capital BV 28/11/2032                                | 105 692          | 0,01              |
| 100 000 1.750% GSK Consumer Healthcare Capital NL BV 29/03/2030         | 95 250           | 0,00              |
| 100 000 2.125% GSK Consumer Healthcare Capital NL BV 29/03/2034         | 91 121           | 0,00              |
| 100 000 3.125% Hamburg Commercial Bank AG 01/07/2026                    | 107 949          | 0,01              |
| 200 000 0.100% Hamburg Commercial Bank AG 02/11/2028                    | 183 760          | 0,01              |
| 100 000 0.125% Hamburger Hochbahn AG 24/02/2031                         | 85 533           | 0,00              |
| 100 000 0.375% Hamburger Sparkasse AG 23/05/2024                        | 104 901          | 0,01              |
| 100 000 1.750% Hammerson Ireland Finance DAC 03/06/2027                 | 87 281           | 0,00              |
| 200 000 0.010% Hana Bank 26/01/2026                                     | 196 849          | 0,01              |
| 200 000 5.875% Hannover Rueck SE 26/08/2043                             | 222 364          | 0,01              |
| 100 000 0.900% Harley-Davidson Financial Services Inc 19/11/2024        | 103 526          | 0,01              |
| 100 000 1.500% Heathrow Funding Ltd 11/02/2030                          | 92 017           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Heathrow Funding Ltd 08/10/2032                          | 87 874           | 0,00              |
| 100 000 1.875% Heathrow Funding Ltd 14/03/2034                          | 85 524           | 0,00              |
| 100 000 1.625% HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 07/04/2026        | 101 662          | 0,00              |
| 100 000 1.500% HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 14/06/2027        | 100 640          | 0,00              |
| 100 000 0.250% Heimstaden Bostad Treasury BV 13/10/2024                 | 98 231           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Heimstaden Bostad Treasury BV 13/04/2028                 | 80 638           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Heimstaden Bostad Treasury BV 24/07/2028                 | 79 927           | 0,00              |
| 150 000 0.750% Heimstaden Bostad Treasury BV 06/09/2029                 | 107 003          | 0,01              |
| 100 000 1.250% Heineken NV 17/03/2027                                   | 99 610           | 0,00              |
| 100 000 2.250% Heineken NV 30/03/2030                                   | 99 907           | 0,00              |
| 100 000 3.875% Heineken NV 23/09/2030                                   | 110 871          | 0,01              |
| 100 000 1.750% Heineken NV 17/03/2031                                   | 94 625           | 0,00              |
| 100 000 4.125% Heineken NV 23/03/2035                                   | 111 695          | 0,01              |
| 100 000 1.000% Hemso Fastighets AB 09/09/2026                           | 94 594           | 0,00              |
| 100 000 2.625% Henkel AG & Co KGaA 13/09/2027                           | 106 353          | 0,01              |
| 100 000 0.500% Henkel AG & Co KGaA 17/11/2032                           | 82 678           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                  |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>            |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 2.500% Hera SpA 25/05/2029   | 99 582           | 0,00              |
| 200 000 0.250% Hera SpA 03/12/2030   | 162 807          | 0,01              |
| 100 000 0.934% Highland Holdings Sarl 15/12/2031                                   | 82 952           | 0,00              |
| 100 000 1.625% Holding d'Infrastructures de Transport SASU 18/09/2029              | 92 991           | 0,00              |
| 100 000 1.475% Holding d'Infrastructures de Transport SASU 18/01/2031              | 88 030           | 0,00              |
| 100 000 0.625% Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement 16/09/2028 | 88 031           | 0,00              |
| 100 000 0.625% HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH 01/11/2028                       | 88 641           | 0,00              |
| 200 000 1.125% HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH 01/11/2033                       | 157 057          | 0,01              |
| 100 000 1.500% HSBC Bank Canada 15/09/2027   | 100 322          | 0,00              |
| 100 000 3.019% HSBC Holdings PLC 15/06/2027  | 104 438          | 0,01              |
| 100 000 4.752% HSBC Holdings PLC 10/03/2028  | 110 526          | 0,01              |
| 200 000 3.125% HSBC Holdings PLC 07/06/2028  | 202 345          | 0,01              |
| 100 000 4.787% HSBC Holdings PLC 10/03/2032  | 111 305          | 0,01              |
| 100 000 6.364% HSBC Holdings PLC 16/11/2032  | 113 445          | 0,01              |
| 100 000 0.500% HSBC SFH France SA 17/04/2025                                       | 102 413          | 0,01              |
| 100 000 0.750% HSBC SFH France SA 22/03/2027                                       | 98 576           | 0,00              |
| 100 000 2.625% HSBC SFH France SA 07/09/2032                                       | 102 995          | 0,01              |
| 100 000 0.125% HYPO NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG 30/06/2026   | 96 280           | 0,00              |
| 100 000 0.010% HYPO NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG 18/06/2027   | 94 855           | 0,00              |
| 100 000 3.125% Hypo Tirol Bank AG 31/01/2028                                       | 107 425          | 0,01              |
| 100 000 4.125% Hypo Vorarlberg Bank AG 16/02/2026                                  | 108 092          | 0,01              |
| 100 000 3.125% Iberdrola Finanzas SA 22/11/2028                                    | 107 576          | 0,01              |
| 100 000 1.375% Iberdrola Finanzas SA 11/03/2032                                    | 93 226           | 0,00              |
| 100 000 3.375% Iberdrola Finanzas SA 22/11/2032                                    | 107 160          | 0,01              |
| 100 000 1.825% Iberdrola International BV (Perpetual)                              | 83 290           | 0,00              |
| 100 000 1.874% Iberdrola International BV (Perpetual)                              | 97 689           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>             |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 3.250% Iberdrola International BV (Perpetual)                         | 104 370          | 0,01              |
| 100 000 1.125% ICADE 17/11/2025   | 101 356          | 0,00              |
| 100 000 1.625% ICADE 28/02/2028   | 95 009           | 0,00              |
| 100 000 0.037% IDB Trust Services Ltd 04/12/2024                              | 102 045          | 0,01              |
| 100 000 0.625% Illinois Tool Works Inc 05/12/2027                             | 94 995           | 0,00              |
| 100 000 1.875% Imerys SA 31/03/2028   | 97 531           | 0,00              |
| 100 000 1.625% Infineon Technologies AG 24/06/2029                            | 96 555           | 0,00              |
| 100 000 2.750% ING Bank NV 21/11/2025   | 107 178          | 0,01              |
| 100 000 0.500% ING Bank NV 17/02/2027   | 98 148           | 0,00              |
| 100 000 0.125% ING Bank NV 08/12/2032   | 84 355           | 0,00              |
| 100 000 1.000% ING Bank NV 17/02/2037   | 81 696           | 0,00              |
| 100 000 0.750% ING Belgium SA 28/09/2026                                      | 99 718           | 0,00              |
| 100 000 1.500% ING Belgium SA 19/05/2029                                      | 98 608           | 0,00              |
| 100 000 0.010% ING Belgium SA 20/02/2030                                      | 87 652           | 0,00              |
| 100 000 2.125% ING Groep NV 23/05/2026  | 104 261          | 0,01              |
| 100 000 4.875% ING Groep NV 14/11/2027  | 110 492          | 0,01              |
| 100 000 1.625% ING Groep NV 26/09/2029  | 102 420          | 0,01              |
| 100 000 1.000% ING Groep NV 13/11/2030  | 97 009           | 0,00              |
| 100 000 1.000% ING Groep NV 16/11/2032  | 89 734           | 0,00              |
| 200 000 5.250% ING Groep NV 14/11/2033  | 228 585          | 0,01              |
| 100 000 5.000% ING Groep NV 20/02/2035  | 106 655          | 0,01              |
| 100 000 0.250% ING-DiBa AG 16/11/2026   | 97 908           | 0,00              |
| 100 000 0.125% ING-DiBa AG 23/05/2027   | 96 064           | 0,00              |
| 100 000 0.010% ING-DiBa AG 07/10/2028   | 91 908           | 0,00              |
| 100 000 1.625% Intermediate Capital Group PLC 17/02/2027                      | 82 048           | 0,00              |
| 150 000 0.000% International Bank for Reconstruction & Development 15/01/2027 | 145 519          | 0,01              |
| 100 000 0.010% International Bank for Reconstruction & Development 24/04/2028 | 93 526           | 0,00              |
| 200 000 0.250% International Bank for Reconstruction & Development 21/05/2029 | 184 394          | 0,01              |
| 50 000 0.500% International Bank for Reconstruction & Development 16/04/2030  | 45 798           | 0,00              |
| 100 000 0.625% International Bank for Reconstruction & Development 12/01/2033 | 86 648           | 0,00              |
| 150 000 0.700% International Bank for Reconstruction & Development 22/10/2046 | 97 163           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>             |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                               |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>                         |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   | <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 200 000 0.250% International Bank for Reconstruction & Development 10/01/2050 | 104 010          | 0,01              | 100 000 4.750% JAB Holdings BV 29/06/2032   | 109 672          | 0,01              |
| 150 000 0.125% International Bank for Reconstruction & Development 03/01/2051 | 72 630           | 0,00              | 100 000 0.000% JDE Peet's NV 16/01/2026   | 96 821           | 0,00              |
| 100 000 0.950% International Business Machines Corp 23/05/2025                | 103 215          | 0,01              | 100 000 0.625% JDE Peet's NV 09/02/2028   | 92 346           | 0,00              |
| 200 000 1.250% International Business Machines Corp 29/01/2027                | 200 574          | 0,01              | 100 000 0.500% JDE Peet's NV 16/01/2029   | 87 586           | 0,00              |
| 100 000 0.875% International Business Machines Corp 09/02/2030                | 90 912           | 0,00              | 100 000 1.000% Jefferies Financial Group Inc 19/07/2024   | 103 903          | 0,01              |
| 100 000 1.250% International Business Machines Corp 09/02/2034                | 83 920           | 0,00              | 100 000 2.200% John Deere Cash Management SARL 02/04/2032                                       | 99 366           | 0,00              |
| 100 000 1.200% International Business Machines Corp 11/02/2040                | 71 752           | 0,00              | 100 000 0.650% Johnson & Johnson 20/05/2024   | 105 653          | 0,01              |
| 100 000 0.010% International Development Association 15/07/2031               | 84 751           | 0,00              | 100 000 0.375% Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA 15/09/2027 | 94 018           | 0,00              |
| 150 000 0.350% International Development Association 22/04/2036               | 115 203          | 0,01              | 100 000 3.000% Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA 15/09/2028 | 104 198          | 0,01              |
| 150 000 2.500% International Development Association 15/01/2038               | 150 372          | 0,01              | 200 000 1.500% JPMorgan Chase & Co 29/10/2026   | 202 010          | 0,01              |
| 200 000 0.700% International Development Association 17/01/2042               | 140 035          | 0,01              | 100 000 1.090% JPMorgan Chase & Co 11/03/2027   | 99 933           | 0,00              |
| 100 000 0.375% Intesa Sanpaolo SpA 14/09/2026                                 | 98 154           | 0,00              | 100 000 1.638% JPMorgan Chase & Co 18/05/2028   | 98 301           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Intesa Sanpaolo SpA 04/10/2027                                 | 98 767           | 0,00              | 100 000 1.963% JPMorgan Chase & Co 23/03/2030   | 96 086           | 0,00              |
| 100 000 0.750% Intesa Sanpaolo SpA 16/03/2028                                 | 92 489           | 0,00              | 100 000 1.001% JPMorgan Chase & Co 25/07/2031   | 87 547           | 0,00              |
| 100 000 1.750% Intesa Sanpaolo SpA 20/03/2028                                 | 97 186           | 0,00              | 100 000 1.047% JPMorgan Chase & Co 04/11/2032   | 84 401           | 0,00              |
| 100 000 1.750% Intesa Sanpaolo SpA 04/07/2029                                 | 93 159           | 0,00              | 100 000 0.597% JPMorgan Chase & Co 17/02/2033   | 81 018           | 0,00              |
| 100 000 5.250% Intesa Sanpaolo SpA 13/01/2030                                 | 112 835          | 0,01              | 100 000 0.000% KAF Kaemtner Ausgleichszahlungs-Fonds 14/01/2032                                 | 81 344           | 0,00              |
| 100 000 1.250% Intesa Sanpaolo SpA 15/01/2030                                 | 95 748           | 0,00              | 100 000 0.000% KBC Bank NV 03/12/2025   | 99 579           | 0,00              |
| 250 000 1.350% Intesa Sanpaolo SpA 24/02/2031                                 | 203 810          | 0,01              | 100 000 1.500% KBC Group NV 29/03/2026  | 103 206          | 0,01              |
| 100 000 0.500% Investitionsbank Berlin 17/04/2026                             | 100 535          | 0,00              | 100 000 0.125% KBC Group NV 10/09/2026  | 98 865           | 0,00              |
| 100 000 1.500% Investor AB 20/06/2039   | 77 310           | 0,00              | 100 000 4.375% KBC Group NV 23/11/2027  | 108 726          | 0,01              |
| 100 000 1.000% Iren SpA 01/07/2030  | 87 936           | 0,00              | 100 000 0.500% KBC Group NV 03/12/2029  | 100 492          | 0,00              |
| 100 000 3.000% Islandsbanki HF 20/09/2027                                     | 104 507          | 0,01              | 119 000 1.000% Kellogg Co 17/05/2024  | 125 506          | 0,01              |
| 100 000 1.250% ISS Finance BV 07/07/2025                                      | 102 306          | 0,01              | 100 000 1.500% Kering SA 05/04/2027   | 101 519          | 0,00              |
| 100 000 1.000% Italgas SpA 11/12/2031   | 86 006           | 0,00              | 100 000 3.250% Kering SA 27/02/2029   | 108 026          | 0,01              |
| 100 000 1.750% JAB Holdings BV 25/06/2026                                     | 101 600          | 0,00              | 100 000 3.375% Kering SA 27/02/2033   | 107 233          | 0,01              |
| 100 000 1.000% JAB Holdings BV 20/12/2027                                     | 94 808           | 0,00              | 100 000 0.625% Kimberly-Clark Corp 07/09/2024   | 104 501          | 0,01              |
| 100 000 1.000% JAB Holdings BV 14/07/2031                                     | 82 440           | 0,00              | 100 000 0.625% Klepierre SA 01/07/2030  | 82 350           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 3.250% Knorr-Bremse AG 21/09/2027   | 106 684          | 0,01              |
|   |                  |                   | 100 000 1.625% Kojamo Oyj 07/03/2025  | 99 344           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 0.010% Komercni Banka AS 20/01/2026   | 98 460           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 0.250% Koninklijke Ahold Delhaize NV 26/06/2025   | 101 364          | 0,00              |
|   |                  |                   | 150 000 5.625% Koninklijke KPN NV 30/09/2024  | 167 953          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 0.875% Koninklijke KPN NV 15/11/2033                            | 81 070           | 0,00              |
| 100 000 1.875% Koninklijke Philips NV 05/05/2027                        | 101 625          | 0,00              |
| 100 000 2.000% Koninklijke Philips NV 30/03/2030                        | 96 207           | 0,00              |
| 300 000 0.052% Kookmin Bank 15/07/2025                                  | 300 616          | 0,01              |
| 100 000 0.048% Kookmin Bank 19/10/2026                                  | 96 118           | 0,00              |
| 100 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 02/04/2024               | 105 406          | 0,01              |
| 100 000 0.050% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 30/05/2024               | 105 026          | 0,01              |
| 50 000 1.500% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 11/06/2024                | 53 374           | 0,00              |
| 150 000 0.125% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 04/10/2024               | 156 149          | 0,01              |
| 200 000 0.625% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/01/2025               | 208 401          | 0,01              |
| 270 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 18/02/2025               | 277 580          | 0,01              |
| 300 000 0.010% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 31/03/2025               | 307 285          | 0,01              |
| 200 000 0.375% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 23/04/2025               | 206 202          | 0,01              |
| 200 000 0.125% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 30/06/2025               | 204 200          | 0,01              |
| 200 000 0.250% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/09/2025               | 203 759          | 0,01              |
| 200 000 2.500% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 19/11/2025               | 215 350          | 0,01              |
| 300 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/06/2026               | 297 295          | 0,01              |
| 100 000 0.500% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 28/09/2026               | 100 216          | 0,00              |
| 100 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 30/09/2026               | 98 387           | 0,00              |
| 300 000 0.625% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 22/02/2027               | 298 837          | 0,01              |
| 400 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 31/03/2027               | 387 676          | 0,02              |
| 350 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 30/04/2027               | 338 539          | 0,01              |
| 200 000 0.010% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 05/05/2027               | 193 345          | 0,01              |
| 300 000 1.250% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 30/06/2027               | 304 691          | 0,01              |
| 200 000 0.500% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/09/2027               | 195 813          | 0,01              |
| 300 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/12/2027               | 285 333          | 0,01              |
| 200 000 0.625% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 07/01/2028               | 195 952          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 50 000 2.750% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/03/2028                | 54 109           | 0,00              |
| 150 000 0.750% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 28/06/2028               | 146 586          | 0,01              |
| 500 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/09/2028               | 466 109          | 0,02              |
| 350 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 09/11/2028               | 325 017          | 0,01              |
| 50 000 0.750% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/01/2029                | 48 254           | 0,00              |
| 200 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/06/2029               | 182 487          | 0,01              |
| 250 000 2.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/11/2029               | 258 105          | 0,01              |
| 250 000 2.875% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 28/12/2029               | 272 300          | 0,01              |
| 350 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 17/09/2030               | 308 142          | 0,01              |
| 300 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 10/01/2031               | 261 925          | 0,01              |
| 200 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/09/2031               | 171 364          | 0,01              |
| 600 000 0.125% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 09/01/2032               | 515 766          | 0,02              |
| 200 000 1.375% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 07/06/2032               | 191 578          | 0,01              |
| 50 000 1.125% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/09/2032                | 46 609           | 0,00              |
| 150 000 1.125% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 09/05/2033               | 137 812          | 0,01              |
| 200 000 0.050% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 29/09/2034               | 155 895          | 0,01              |
| 100 000 1.375% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 31/07/2035               | 90 224           | 0,00              |
| 100 000 0.375% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 20/05/2036               | 77 348           | 0,00              |
| 200 000 1.125% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 31/03/2037               | 168 434          | 0,01              |
| 200 000 1.125% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/06/2037               | 167 476          | 0,01              |
| 50 000 0.875% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 04/07/2039                | 38 911           | 0,00              |
| 100 000 0.500% La Banque Postale Home Loan SFH SA 30/01/2026            | 100 394          | 0,00              |
| 100 000 3.250% La Banque Postale Home Loan SFH SA 23/01/2030            | 109 008          | 0,01              |
| 200 000 0.250% La Banque Postale Home Loan SFH SA 12/02/2035            | 152 929          | 0,01              |
| 100 000 1.000% La Banque Postale SA 09/02/2028                          | 95 074           | 0,00              |



## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>        |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 3.000% La Banque Postale SA 09/06/2028                           | 100 865          | 0,00              |
| 100 000 0.750% La Banque Postale SA 23/06/2031                           | 82 517           | 0,00              |
| 100 000 5.500% La Banque Postale SA 05/03/2034                           | 107 525          | 0,01              |
| 100 000 0.625% La Poste SA 21/10/2026                                    | 98 055           | 0,00              |
| 200 000 2.625% La Poste SA 14/09/2028                                    | 209 061          | 0,01              |
| 100 000 0.000% La Poste SA 18/07/2029                                    | 86 355           | 0,00              |
| 69 000 0.375% Landesbank Baden-Wuerttemberg 27/02/2025                   | 70 904           | 0,00              |
| 50 000 0.875% Landesbank Baden-Wuerttemberg 15/09/2025                   | 51 291           | 0,00              |
| 50 000 0.010% Landesbank Baden-Wuerttemberg 17/06/2026                   | 49 126           | 0,00              |
| 100 000 0.375% Landesbank Baden-Wuerttemberg 29/07/2026                  | 94 433           | 0,00              |
| 100 000 2.375% Landesbank Baden-Wuerttemberg 26/02/2027                  | 105 689          | 0,01              |
| 100 000 1.750% Landesbank Baden-Wuerttemberg 28/02/2028                  | 102 414          | 0,01              |
| 50 000 0.010% Landesbank Baden-Wuerttemberg 18/09/2028                   | 46 109           | 0,00              |
| 200 000 0.375% Landesbank Baden-Wuerttemberg 07/05/2029                  | 166 805          | 0,01              |
| 100 000 0.125% Landesbank Baden-Wuerttemberg 24/07/2029                  | 90 741           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale 16/01/2026      | 100 813          | 0,00              |
| 100 000 0.010% Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale 19/07/2027      | 95 328           | 0,00              |
| 100 000 0.010% Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale 26/09/2029      | 89 468           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale 22/01/2030      | 89 338           | 0,00              |
| 200 000 4.500% Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale 15/09/2032      | 205 324          | 0,01              |
| 100 000 0.500% Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale 19/01/2037      | 76 537           | 0,00              |
| 50 000 0.750% Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank 16/03/2032 | 44 968           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Landwirtschaftliche Rentenbank 06/03/2025                 | 103 482          | 0,01              |
| 100 000 0.250% Landwirtschaftliche Rentenbank 29/08/2025                 | 101 794          | 0,00              |
| 100 000 0.000% Landwirtschaftliche Rentenbank 28/09/2026                 | 98 089           | 0,00              |
| 100 000 0.100% Landwirtschaftliche Rentenbank 08/03/2027                 | 97 235           | 0,00              |
| 100 000 0.375% Landwirtschaftliche Rentenbank 14/02/2028                 | 96 116           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 200 000 0.000% Landwirtschaftliche Rentenbank 19/07/2028                | 186 394          | 0,01              |
| 200 000 0.000% Landwirtschaftliche Rentenbank 13/12/2028                | 184 268          | 0,01              |
| 150 000 0.500% Landwirtschaftliche Rentenbank 28/02/2029                | 141 733          | 0,01              |
| 100 000 0.625% Landwirtschaftliche Rentenbank 20/02/2030                | 93 153           | 0,00              |
| 100 000 0.050% Landwirtschaftliche Rentenbank 31/01/2031                | 86 856           | 0,00              |
| 100 000 1.900% Landwirtschaftliche Rentenbank 12/07/2032                | 99 459           | 0,00              |
| 100 000 0.050% Lansforsakringar Bank AB 15/04/2026                      | 96 441           | 0,00              |
| 200 000 0.625% Lansforsakringar Hypotek AB 27/03/2025                   | 205 682          | 0,01              |
| 200 000 0.625% Lansforsakringar Hypotek AB 29/01/2026                   | 201 478          | 0,01              |
| 45 000 0.000% LANXESS AG 08/09/2027                                     | 42 041           | 0,00              |
| 100 000 1.750% LANXESS AG 22/03/2028                                    | 98 202           | 0,00              |
| 100 000 0.625% LANXESS AG 01/12/2029                                    | 85 875           | 0,00              |
| 100 000 3.500% LeasePlan Corp NV 09/04/2025                             | 107 333          | 0,01              |
| 100 000 0.250% LeasePlan Corp NV 23/02/2026                             | 97 397           | 0,00              |
| 100 000 0.000% Leasys SpA 22/07/2024                                    | 103 433          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Legrand SA 06/07/2024                                    | 105 213          | 0,01              |
| 100 000 0.250% Liberbank SA 25/09/2029                                  | 88 674           | 0,00              |
| 100 000 2.750% Liberty Mutual Group Inc 04/05/2026                      | 104 419          | 0,01              |
| 100 000 1.000% Linde PLC 31/03/2027                                     | 100 538          | 0,00              |
| 100 000 1.375% Linde PLC 31/03/2031                                     | 93 891           | 0,00              |
| 100 000 1.625% Linde PLC 31/03/2035                                     | 88 898           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Linde PLC 30/09/2051                                     | 59 223           | 0,00              |
| 180 000 1.250% Lloyds Bank PLC 13/01/2025                               | 187 187          | 0,01              |
| 200 000 0.625% Lloyds Bank PLC 26/03/2025                               | 205 374          | 0,01              |
| 100 000 0.125% Lloyds Bank PLC 18/06/2026                               | 97 900           | 0,00              |
| 200 000 0.125% Lloyds Bank PLC 23/09/2029                               | 177 639          | 0,01              |
| 100 000 4.500% Lloyds Banking Group PLC 11/01/2029                      | 108 871          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Logicor Financing Sarl 15/07/2024                        | 101 015          | 0,00              |
| 100 000 2.250% Logicor Financing Sarl 13/05/2025                        | 99 473           | 0,00              |
| 100 000 3.250% Logicor Financing Sarl 13/11/2028                        | 87 663           | 0,00              |
| 100 000 1.750% London Stock Exchange Group PLC 06/12/2027               | 100 467          | 0,00              |
| 100 000 0.875% L'Oreal SA 29/06/2026                                    | 101 279          | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 1.625% Louis Dreyfus Co Finance BV 28/04/2028                   | 94 618           | 0,00              |
| 100 000 0.010% Luminor Bank AS/Estonia 11/03/2025                       | 101 359          | 0,00              |
| 100 000 1.750% Lunar Funding V for Swisscom AG 15/09/2025               | 104 361          | 0,01              |
| 100 000 0.125% LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE 11/02/2028           | 94 021           | 0,00              |
| 100 000 0.375% LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE 11/02/2031           | 87 331           | 0,00              |
| 100 000 0.943% Macquarie Group Ltd 19/01/2029                           | 88 088           | 0,00              |
| 100 000 4.375% Magna International Inc 17/03/2032                       | 111 167          | 0,01              |
| 100 000 1.750% ManpowerGroup Inc 22/06/2026                             | 101 782          | 0,00              |
| 100 000 2.100% Mastercard Inc 01/12/2027                                | 103 550          | 0,01              |
| 100 000 1.000% Mastercard Inc 22/02/2029                                | 95 329           | 0,00              |
| 200 000 0.242% mBank Hipoteczny SA 15/09/2025                           | 200 424          | 0,01              |
| 100 000 0.250% McDonald's Corp 04/10/2028                               | 90 556           | 0,00              |
| 100 000 2.375% McDonald's Corp 31/05/2029                               | 101 026          | 0,00              |
| 100 000 3.000% McDonald's Corp 31/05/2034                               | 100 562          | 0,00              |
| 100 000 1.125% Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 15/07/2025   | 102 221          | 0,01              |
| 100 000 1.000% Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 17/07/2029   | 90 539           | 0,00              |
| 200 000 1.125% Medtronic Global Holdings SCA 07/03/2027                 | 199 635          | 0,01              |
| 100 000 0.375% Medtronic Global Holdings SCA 15/10/2028                 | 92 222           | 0,00              |
| 100 000 3.000% Medtronic Global Holdings SCA 15/10/2028                 | 106 191          | 0,01              |
| 100 000 3.125% Medtronic Global Holdings SCA 15/10/2031                 | 105 929          | 0,01              |
| 100 000 3.375% Medtronic Global Holdings SCA 15/10/2034                 | 105 452          | 0,01              |
| 100 000 2.250% Medtronic Global Holdings SCA 07/03/2039                 | 87 417           | 0,00              |
| 100 000 1.500% Medtronic Global Holdings SCA 02/07/2039                 | 77 453           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Medtronic Global Holdings SCA 15/10/2040                 | 74 551           | 0,00              |
| 50 000 3.000% Mercedes-Benz Finance Canada Inc 23/02/2027               | 53 551           | 0,00              |
| 50 000 1.500% Mercedes-Benz Group AG 03/07/2029                         | 48 641           | 0,00              |
| 15 000 0.750% Mercedes-Benz Group AG 08/02/2030                         | 13 658           | 0,00              |
| 50 000 2.375% Mercedes-Benz Group AG 22/05/2030                         | 50 952           | 0,00              |

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>        |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 45 000 0.750% Mercedes-Benz Group AG 10/09/2030                          | 40 674           | 0,00              |
| 50 000 2.000% Mercedes-Benz Group AG 27/02/2031                          | 48 989           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Mercedes-Benz Group AG 06/11/2031                         | 88 687           | 0,00              |
| 55 000 0.750% Mercedes-Benz Group AG 11/03/2033                          | 46 231           | 0,00              |
| 50 000 2.125% Mercedes-Benz Group AG 03/07/2037                          | 44 524           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Mercedes-Benz International Finance BV 11/11/2025         | 102 485          | 0,01              |
| 100 000 1.500% Mercedes-Benz International Finance BV 09/03/2026         | 103 455          | 0,01              |
| 100 000 0.375% Mercedes-Benz International Finance BV 08/11/2026         | 98 552           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Merck Financial Services GmbH 16/07/2025                  | 101 120          | 0,00              |
| 100 000 1.750% Merlin Properties Socimi SA 26/05/2025                    | 103 057          | 0,01              |
| 100 000 1.375% Merlin Properties Socimi SA 01/06/2030                    | 81 666           | 0,00              |
| 100 000 0.550% Metropolitan Life Global Funding I 16/06/2027             | 95 070           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Metropolitan Life Global Funding I 25/05/2029             | 88 662           | 0,00              |
| 100 000 3.750% Metropolitan Life Global Funding I 05/12/2030             | 107 344          | 0,01              |
| 100 000 3.125% Microsoft Corp 06/12/2028                                 | 108 798          | 0,01              |
| 200 000 2.264% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 14/06/2025             | 212 025          | 0,01              |
| 100 000 0.118% Mizuho Financial Group Inc 06/09/2024                     | 103 028          | 0,01              |
| 100 000 1.631% Mizuho Financial Group Inc 08/04/2027                     | 99 501           | 0,00              |
| 100 000 4.157% Mizuho Financial Group Inc 20/05/2028                     | 108 909          | 0,01              |
| 100 000 2.096% Mizuho Financial Group Inc 08/04/2032                     | 91 113           | 0,00              |
| 100 000 4.416% Mizuho Financial Group Inc 20/05/2033                     | 110 221          | 0,01              |
| 100 000 1.250% MMS USA Holdings Inc 13/06/2028                           | 96 448           | 0,00              |
| 100 000 1.750% Mohawk Capital Finance SA 12/06/2027                      | 99 731           | 0,00              |
| 100 000 1.250% Molson Coors Beverage Co 15/07/2024                       | 104 828          | 0,01              |
| 100 000 0.250% Mondelez International Holdings Netherlands BV 09/09/2029 | 87 490           | 0,00              |
| 100 000 0.625% Mondelez International Holdings Netherlands BV 09/09/2032 | 81 429           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>                                    |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 200 000 0.250% Mondelez International Inc 17/03/2028   | 183 423          | 0,01              |
| 100 000 2.375% Mondi Finance Europe GmbH 01/04/2028  | 99 966           | 0,00              |
| 100 000 1.625% Mondi Finance PLC 27/04/2026  | 100 954          | 0,00              |
| 100 000 2.103% Morgan Stanley 08/05/2026   | 104 223          | 0,01              |
| 100 000 1.875% Morgan Stanley 27/04/2027   | 100 954          | 0,00              |
| 100 000 4.813% Morgan Stanley 25/10/2028   | 111 163          | 0,01              |
| 100 000 2.950% Morgan Stanley 07/05/2032   | 98 843           | 0,00              |
| 100 000 1.102% Morgan Stanley 29/04/2033   | 82 755           | 0,00              |
| 100 000 5.148% Morgan Stanley 25/01/2034   | 114 199          | 0,01              |
| 50 000 3.000% MTU Aero Engines AG 01/07/2025   | 53 675           | 0,00              |
| 50 000 0.500% Muenchener Hypothekbank eG 14/03/2025  | 51 418           | 0,00              |
| 100 000 0.875% Muenchener Hypothekbank eG 12/09/2025   | 101 318          | 0,00              |
| 100 000 3.000% Muenchener Hypothekbank eG 04/08/2027   | 108 205          | 0,01              |
| 50 000 0.625% Muenchener Hypothekbank eG 10/11/2027  | 48 610           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Muenchener Hypothekbank eG 01/02/2029   | 91 749           | 0,00              |
| 100 000 1.250% Muenchener Hypothekbank eG 14/02/2030   | 96 747           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Muenchener Hypothekbank eG 18/04/2039   | 78 696           | 0,00              |
| 50 000 0.010% Muenchener Hypothekbank eG 19/10/2039  | 32 062           | 0,00              |
| 150 000 0.010% Muenchener Hypothekbank eG 02/11/2040   | 93 346           | 0,00              |
| 100 000 1.250% Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen 26/05/2041                        | 81 360           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen 26/05/2042                        | 76 438           | 0,00              |
| 100 000 2.125% Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal 21/06/2052 | 75 385           | 0,00              |
| 100 000 0.875% MVM Energetika Zrt 18/11/2027   | 84 905           | 0,00              |
| 100 000 0.750% National Australia Bank Ltd 30/01/2026  | 100 751          | 0,00              |
| 100 000 0.625% National Australia Bank Ltd 16/03/2027  | 97 396           | 0,00              |
| 100 000 2.125% National Australia Bank Ltd 24/05/2028  | 101 704          | 0,00              |
| 100 000 1.375% National Australia Bank Ltd 30/08/2028  | 97 245           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 0.750% National Bank of Canada 13/03/2025                       | 103 057          | 0,01              |
| 100 000 1.054% National Grid North America Inc 20/01/2031               | 87 384           | 0,00              |
| 100 000 2.179% National Grid PLC 30/06/2026                             | 104 121          | 0,01              |
| 100 000 0.553% National Grid PLC 18/09/2029                             | 87 732           | 0,00              |
| 100 000 2.949% National Grid PLC 30/03/2030                             | 101 658          | 0,00              |
| 100 000 3.245% National Grid PLC 30/03/2034                             | 98 114           | 0,00              |
| 200 000 0.375% Nationale-Nederlanden Bank NV Netherlands 26/02/2025     | 202 608          | 0,01              |
| 100 000 0.625% Nationale-Nederlanden Bank NV/The Netherlands 11/09/2055 | 101 674          | 0,00              |
| 100 000 1.250% Nationwide Building Society 03/03/2025                   | 103 541          | 0,01              |
| 100 000 2.000% Nationwide Building Society 28/04/2027                   | 100 742          | 0,00              |
| 100 000 0.250% Nationwide Building Society 14/09/2028                   | 87 957           | 0,00              |
| 100 000 2.000% Nationwide Building Society 25/07/2029                   | 104 000          | 0,01              |
| 100 000 3.250% Nationwide Building Society 05/09/2029                   | 102 404          | 0,01              |
| 100 000 1.375% Nationwide Building Society 29/06/2032                   | 92 117           | 0,00              |
| 300 000 0.500% Nationwide Building Society 05/05/2041                   | 202 132          | 0,01              |
| 300 000 1.125% Naturgy Capital Markets SA 11/04/2024                    | 318 914          | 0,01              |
| 100 000 4.067% NatWest Group PLC 06/09/2028                             | 106 724          | 0,01              |
| 100 000 0.125% NatWest Markets PLC 12/11/2025                           | 98 400           | 0,00              |
| 100 000 1.375% NatWest Markets PLC 02/03/2027                           | 97 951           | 0,00              |
| 100 000 3.375% NE Property BV 14/07/2027                                | 95 609           | 0,00              |
| 100 000 2.000% NE Property BV 20/01/2030                                | 76 926           | 0,00              |
| 137 000 1.375% Nederlandse Gasunie NV 16/10/2028                        | 133 257          | 0,01              |
| 100 000 3.375% Nederlandse Gasunie NV 11/07/2034                        | 105 652          | 0,01              |
| 100 000 0.250% Nederlandse Waterschapsbank NV 19/01/2032                | 85 415           | 0,00              |
| 50 000 0.000% Nestle Finance International Ltd 14/06/2026               | 49 288           | 0,00              |
| 71 000 3.500% Nestle Finance International Ltd 13/12/2027               | 78 509           | 0,00              |
| 50 000 0.250% Nestle Finance International Ltd 14/06/2029               | 45 802           | 0,00              |
| 100 000 1.250% Nestle Finance International Ltd 29/03/2031              | 93 270           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   | <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 3.750% Nestle Finance International Ltd 13/03/2033              | 112 718          | 0,01              | 100 000 0.000% NRW Bank 22/09/2028                                      | 92 320           | 0,00              |
| 75 000 0.625% Nestle Finance International Ltd 14/02/2034               | 61 649           | 0,00              | 100 000 0.000% NRW Bank 18/02/2030                                      | 88 678           | 0,00              |
| 50 000 1.500% Nestle Finance International Ltd 29/03/2035               | 44 499           | 0,00              | 50 000 1.625% NRW Bank 03/08/2032                                       | 48 379           | 0,00              |
| 75 000 0.875% Nestle Finance International Ltd 14/06/2041               | 53 690           | 0,00              | 200 000 0.100% NRW Bank 09/07/2035                                      | 150 456          | 0,01              |
| 100 000 0.250% NIBC Bank NV 09/09/2026                                  | 92 366           | 0,00              | 100 000 2.500% NRW Bank 07/09/2037                                      | 99 646           | 0,00              |
| 100 000 1.000% NIBC Bank NV 11/09/2028                                  | 96 616           | 0,00              | 100 000 2.750% NTPC Ltd 01/02/2027                                      | 99 721           | 0,00              |
| 100 000 4.375% NN Group NV (Perpetual)                                  | 106 505          | 0,01              | 100 000 0.250% Nykredit Realkredit AS 13/01/2026                        | 97 669           | 0,00              |
| 200 000 0.050% NORD/LB Luxembourg SA Covered Bond Bank 28/01/2025       | 203 692          | 0,01              | 100 000 0.750% Nykredit Realkredit AS 20/01/2027                        | 94 553           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Norddeutsche Landesbank-Girozentrale 03/11/2025          | 103 536          | 0,01              | 500 000 0.375% Nykredit Realkredit AS 17/01/2028                        | 452 034          | 0,02              |
| 50 000 0.625% Norddeutsche Landesbank-Girozentrale 18/01/2027           | 49 403           | 0,00              | 100 000 4.000% Nykredit Realkredit AS 17/07/2028                        | 106 166          | 0,01              |
| 100 000 2.250% Norddeutsche Landesbank-Girozentrale 20/09/2027          | 104 750          | 0,01              | 200 000 0.875% Nykredit Realkredit AS 28/07/2031                        | 188 132          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Norddeutsche Landesbank-Girozentrale 18/01/2028          | 97 294           | 0,00              | 100 000 5.500% Nykredit Realkredit AS 29/12/2032                        | 107 994          | 0,01              |
| 50 000 0.750% Norddeutsche Landesbank-Girozentrale 05/03/2029           | 47 483           | 0,00              | 100 000 3.875% OeBB-Infrastruktur AG 30/06/2025                         | 110 038          | 0,01              |
| 100 000 1.125% Nordea Bank Abp 12/02/2025                               | 103 566          | 0,01              | 200 000 3.500% OeBB-Infrastruktur AG 19/10/2026                         | 220 015          | 0,01              |
| 100 000 1.125% Nordea Bank Abp 16/02/2027                               | 98 188           | 0,00              | 150 000 3.375% OeBB-Infrastruktur AG 18/05/2032                         | 167 420          | 0,01              |
| 100 000 0.500% Nordea Bank Abp 14/05/2027                               | 95 716           | 0,00              | 100 000 3.125% Oma Saastopankki Oyj 15/06/2028                          | 107 613          | 0,01              |
| 200 000 0.500% Nordea Bank Abp 02/11/2028                               | 180 405          | 0,01              | 150 000 1.000% OMV AG 14/12/2026  | 149 713          | 0,01              |
| 100 000 2.500% Nordea Bank Abp 23/05/2029                               | 99 470           | 0,00              | 100 000 3.500% OMV AG 27/09/2027  | 108 485          | 0,01              |
| 100 000 1.000% Nordea Bank Abp 27/06/2029                               | 103 259          | 0,01              | 100 000 0.750% OMV AG 16/06/2030  | 89 905           | 0,00              |
| 100 000 2.875% Nordea Bank Abp 24/08/2032                               | 98 542           | 0,00              | 100 000 2.875% OP Corporate Bank plc 15/12/2025                         | 106 205          | 0,01              |
| 200 000 0.625% Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj 23/05/2025              | 205 037          | 0,01              | 100 000 0.250% OP Corporate Bank plc 24/03/2026                         | 97 044           | 0,00              |
| 100 000 2.625% Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj 01/12/2025              | 106 859          | 0,01              | 100 000 4.125% OP Corporate Bank plc 18/04/2027                         | 109 659          | 0,01              |
| 100 000 0.250% Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj 18/03/2026              | 99 458           | 0,00              | 100 000 0.375% OP Corporate Bank plc 16/06/2028                         | 88 848           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj 18/06/2027              | 95 693           | 0,00              | 100 000 0.375% OP Corporate Bank plc 08/12/2028                         | 87 369           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj 30/03/2029              | 96 039           | 0,00              | 100 000 2.750% OP Mortgage Bank 22/06/2026                              | 106 861          | 0,01              |
| 100 000 2.500% Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj 14/09/2032              | 103 016          | 0,01              | 100 000 1.000% OP Mortgage Bank 05/10/2027                              | 98 891           | 0,00              |
| 135 000 0.000% Novartis Finance SA 23/09/2028                           | 123 217          | 0,01              | 100 000 0.050% OP Mortgage Bank 21/04/2028                              | 93 197           | 0,00              |
| 100 000 0.250% NRW Bank 10/03/2025                                      | 102 527          | 0,01              | 100 000 0.000% Orange SA 29/06/2026                                     | 97 153           | 0,00              |
| 100 000 0.250% NRW Bank 04/07/2025                                      | 101 712          | 0,00              | 100 000 0.125% Orange SA 16/09/2029                                     | 87 693           | 0,00              |
| 50 000 0.500% NRW Bank 11/05/2026                                       | 50 138           | 0,00              | 100 000 3.625% Orange SA 16/11/2031                                     | 108 232          | 0,01              |
| 150 000 0.250% NRW Bank 16/03/2027                                      | 146 270          | 0,01              | 100 000 0.500% Orange SA 04/09/2032                                     | 81 712           | 0,00              |
| 100 000 0.500% NRW Bank 13/09/2027                                      | 97 339           | 0,00              | 100 000 8.125% Orange SA 28/01/2033                                     | 147 779          | 0,01              |
|   |                  |                   | 100 000 0.750% Orange SA 29/06/2034                                     | 77 889           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                   |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>             |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 1.375% Orange SA 04/09/2049   | 71 096           | 0,00              |
| 100 000 1.750% Orange SA (Perpetual)  | 90 719           | 0,00              |
| 100 000 4.875% Orano SA 23/09/2024  | 110 294          | 0,01              |
| 100 000 5.375% Orano SA 15/05/2027  | 112 222          | 0,01              |
| 100 000 1.000% Origin Energy Finance Ltd 17/09/2029                                 | 101 800          | 0,00              |
| 100 000 4.477% ORIX Corp 01/06/2028   | 109 773          | 0,01              |
| 100 000 3.625% Orsted AS 01/03/2026   | 109 282          | 0,01              |
| 100 000 2.250% Orsted AS 14/06/2028   | 102 360          | 0,01              |
| 100 000 3.750% Orsted AS 01/03/2030   | 109 651          | 0,01              |
| 100 000 3.250% Orsted AS 13/09/2031   | 105 366          | 0,01              |
| 100 000 2.875% Orsted AS 14/06/2033   | 100 270          | 0,00              |
| 100 000 4.125% Orsted AS 01/03/2035   | 110 671          | 0,01              |
| 100 000 0.875% OTE PLC 24/09/2026   | 98 671           | 0,00              |
| 100 000 0.625% Oversea-Chinese Banking Corp Ltd 18/04/2025                          | 102 522          | 0,01              |
| 100 000 0.000% PACCAR Financial Europe BV 01/03/2026                                | 98 652           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Parker-Hannifin Corp 01/03/2025                                      | 102 873          | 0,01              |
| 100 000 0.250% PepsiCo Inc 06/05/2024   | 105 176          | 0,01              |
| 100 000 1.050% PepsiCo Inc 09/10/2050   | 65 639           | 0,00              |
| 100 000 1.875% PerkinElmer Inc 19/07/2026   | 101 316          | 0,00              |
| 100 000 0.500% Pernod Ricard SA 24/10/2027  | 95 817           | 0,00              |
| 100 000 3.250% Pernod Ricard SA 02/11/2028  | 107 520          | 0,01              |
| 100 000 1.375% Pernod Ricard SA 07/04/2029  | 96 668           | 0,00              |
| 100 000 3.750% Pernod Ricard SA 02/11/2032  | 109 737          | 0,01              |
| 100 000 1.875% Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 05/11/2031 | 81 660           | 0,00              |
| 100 000 1.450% Philip Morris International Inc 01/08/2039                           | 63 109           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Poste Italiane SpA 10/12/2028  | 87 465           | 0,00              |
| 100 000 2.750% PPG Industries Inc 01/06/2029  | 101 228          | 0,00              |
| 100 000 0.625% Procter & Gamble Co 30/10/2024                                       | 104 444          | 0,01              |
| 100 000 4.875% Procter & Gamble Co 11/05/2027                                       | 115 663          | 0,01              |
| 100 000 0.350% Procter & Gamble Co 05/05/2030                                       | 89 491           | 0,00              |
| 100 000 0.900% Procter & Gamble Co 04/11/2041                                       | 71 415           | 0,00              |
| 100 000 4.250% Programa Cedula TDA Fondo de Titulizacion de Activos 28/03/2027      | 111 865          | 0,01              |
| 100 000 4.250% Programa Cedula TDA Fondo de Titulizacion de Activos 10/04/2031      | 115 341          | 0,01              |
| 100 000 1.875% Prologis Euro Finance LLC 05/01/2029                                 | 94 745           | 0,00              |

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>        |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 3.875% Prologis Euro Finance LLC 31/01/2030                      | 103 797          | 0,01              |
| 125 000 1.750% Prologis International Funding II SA 15/03/2028           | 119 988          | 0,01              |
| 125 000 1.625% Prologis International Funding II SA 17/06/2032           | 101 010          | 0,00              |
| 100 000 1.207% Prosus NV 19/01/2026                                      | 97 130           | 0,00              |
| 100 000 2.085% Prosus NV 19/01/2030                                      | 85 357           | 0,00              |
| 100 000 2.778% Prosus NV 19/01/2034                                      | 80 272           | 0,00              |
| 100 000 0.750% Proximus SADP 17/11/2036                                  | 72 616           | 0,00              |
| 50 000 6.000% PSA Tresorerie GIE 19/09/2033                              | 59 806           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Pterosaur Capital Co Ltd 25/09/2024                       | 101 834          | 0,00              |
| 100 000 0.875% Public Storage 24/01/2032                                 | 77 191           | 0,00              |
| 100 000 2.875% Raiffeisen Bank International AG 28/09/2026               | 106 392          | 0,01              |
| 100 000 1.500% Raiffeisen Bank International AG 24/05/2028               | 100 561          | 0,00              |
| 100 000 8.750% Raiffeisen Bank zrt 22/11/2025                            | 109 801          | 0,01              |
| 100 000 7.125% Raiffeisenbank AS 19/01/2026                              | 108 255          | 0,01              |
| 100 000 0.375% Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG 13/09/2024 | 103 871          | 0,01              |
| 100 000 0.625% Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG 03/03/2025 | 102 930          | 0,01              |
| 100 000 3.250% Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG 11/01/2030 | 108 105          | 0,01              |
| 100 000 1.375% Raiffeisen-Landesbank Steiermark AG 11/05/2033            | 90 830           | 0,00              |
| 100 000 3.000% Raiffeisen-Landesbank Tirol AG 24/01/2028                 | 106 845          | 0,01              |
| 250 000 1.625% RCI Banque SA 26/05/2026                                  | 249 634          | 0,01              |
| 70 000 4.875% RCI Banque SA 21/09/2028                                   | 76 369           | 0,00              |
| 100 000 3.875% Rentokil Initial Finance BV 27/06/2027                    | 108 387          | 0,01              |
| 100 000 0.500% Rentokil Initial PLC 14/10/2028                           | 90 098           | 0,00              |
| 100 000 0.375% Repsol Europe Finance Sarl 06/07/2029                     | 89 469           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Repsol International Finance BV 05/10/2024                | 103 519          | 0,01              |
| 100 000 3.750% Repsol International Finance BV (Perpetual)               | 102 259          | 0,01              |
| 100 000 4.247% Repsol International Finance BV (Perpetual)               | 97 563           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Richemont International Holding SA 26/05/2032             | 89 487           | 0,00              |
| 100 000 2.000% Richemont International Holding SA 26/03/2038             | 86 865           | 0,00              |
| 100 000 2.625% Robert Bosch Investment Nederland BV 24/05/2028           | 106 105          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 3.204% Roche Finance Europe BV 27/08/2029                       | 108 998          | 0,01              |
| 100 000 3.355% Roche Finance Europe BV 27/02/2035                       | 109 166          | 0,01              |
| 100 000 0.125% Royal Bank of Canada 23/07/2024                          | 103 709          | 0,01              |
| 200 000 2.375% Royal Bank of Canada 13/09/2027                          | 208 672          | 0,01              |
| 100 000 0.010% Royal Bank of Canada 05/10/2028                          | 90 734           | 0,00              |
| 100 000 2.125% Royal Bank of Canada 26/04/2029                          | 96 733           | 0,00              |
| 100 000 0.010% Royal Bank of Canada 27/01/2031                          | 84 060           | 0,00              |
| 100 000 2.000% Royal Schiphol Group NV 05/10/2026                       | 102 742          | 0,01              |
| 100 000 1.625% RTE Reseau de Transport d'Electricite SADR 08/10/2024    | 105 463          | 0,01              |
| 100 000 2.750% RTE Reseau de Transport d'Electricite SADR 20/06/2029    | 105 332          | 0,01              |
| 100 000 0.750% RTE Reseau de Transport d'Electricite SADR 12/01/2034    | 82 105           | 0,00              |
| 100 000 2.500% RWE AG 24/08/2025  | 106 417          | 0,01              |
| 100 000 2.125% RWE AG 24/05/2026  | 104 080          | 0,01              |
| 50 000 2.750% RWE AG 24/05/2030   | 50 561           | 0,00              |
| 100 000 0.625% RWE AG 11/06/2031  | 83 717           | 0,00              |
| 100 000 0.875% Ryanair DAC 25/05/2026                                   | 99 062           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 04/09/2026           | 78 235           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 12/08/2027           | 72 478           | 0,00              |
| 100 000 0.875% Sanofi 06/04/2025  | 103 825          | 0,01              |
| 100 000 1.000% Sanofi 21/03/2026  | 102 084          | 0,01              |
| 100 000 0.875% Sanofi 21/03/2029  | 95 537           | 0,00              |
| 100 000 1.250% Sanofi 06/04/2029  | 97 463           | 0,00              |
| 100 000 1.500% Sanofi 01/04/2030  | 97 250           | 0,00              |
| 100 000 0.250% Santander Consumer Bank AG 15/10/2024                    | 102 447          | 0,01              |
| 100 000 0.050% Santander Consumer Bank AG 14/02/2030                    | 88 763           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Santander Consumer Bank AS 14/04/2026                    | 96 424           | 0,00              |
| 100 000 0.000% Santander Consumer Finance SA 23/02/2026                 | 96 816           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Santander Consumer Finance SA 14/01/2027                 | 95 907           | 0,00              |
| 200 000 3.530% Santander UK Group Holdings PLC 25/08/2028               | 205 374          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 0.603% Santander UK Group Holdings PLC 13/09/2029               | 86 587           | 0,00              |
| 200 000 0.050% Santander UK PLC 12/01/2027                              | 191 780          | 0,01              |
| 100 000 1.125% Santander UK PLC 12/03/2027                              | 99 642           | 0,00              |
| 300 000 1.625% SAP SE 10/03/2031  | 287 188          | 0,01              |
| 100 000 1.875% SBAB Bank AB 10/12/2025                                  | 103 928          | 0,01              |
| 100 000 1.450% Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 28/03/2029 | 89 927           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Schlumberger Finance BV 28/10/2026                       | 101 050          | 0,00              |
| 100 000 2.000% Schlumberger Finance BV 06/05/2032                       | 94 360           | 0,00              |
| 100 000 1.500% Schneider Electric SE 15/01/2028                         | 100 576          | 0,00              |
| 100 000 3.375% Schneider Electric SE 13/04/2034                         | 107 074          | 0,01              |
| 100 000 1.250% Segro Capital Sarl 23/03/2026                            | 96 846           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Segro Capital Sarl 22/09/2031                            | 73 642           | 0,00              |
| 100 000 1.500% SELP Finance Sarl 20/11/2025                             | 98 084           | 0,00              |
| 150 000 1.500% SELP Finance Sarl 20/12/2026                             | 141 052          | 0,01              |
| 100 000 3.500% SES SA 14/01/2029  | 97 442           | 0,00              |
| 100 000 0.125% SGS Nederland Holding BV 21/04/2027                      | 93 778           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Shell International Finance BV 07/04/2024                | 106 152          | 0,01              |
| 100 000 0.500% Shell International Finance BV 11/05/2024                | 105 295          | 0,01              |
| 100 000 1.500% Shell International Finance BV 07/04/2028                | 99 164           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Shell International Finance BV 08/11/2031                | 83 845           | 0,00              |
| 100 000 1.875% Shell International Finance BV 07/04/2032                | 93 755           | 0,00              |
| 100 000 1.250% Shell International Finance BV 11/11/2032                | 87 414           | 0,00              |
| 100 000 0.875% Shell International Finance BV 08/11/2039                | 67 947           | 0,00              |
| 100 000 0.625% Siemens Financieringsmaatschappij NV 25/02/2027          | 98 347           | 0,00              |
| 100 000 0.250% Siemens Financieringsmaatschappij NV 20/02/2029          | 91 655           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Siemens Financieringsmaatschappij NV 25/02/2030          | 93 164           | 0,00              |
| 50 000 1.375% Siemens Financieringsmaatschappij NV 06/09/2030           | 47 558           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 2.750% Siemens Financieringsmaatschappij NV 09/09/2030          | 104 016          | 0,01              |
| 100 000 1.250% Siemens Financieringsmaatschappij NV 28/02/2031          | 92 972           | 0,00              |
| 100 000 3.375% Siemens Financieringsmaatschappij NV 24/08/2031          | 108 957          | 0,01              |
| 100 000 3.625% Siemens Financieringsmaatschappij NV 24/02/2043          | 105 629          | 0,01              |
| 150 000 2.375% Signify NV 11/05/2027                                    | 152 495          | 0,01              |
| 100 000 1.250% Simon International Finance SCA 13/05/2025               | 101 939          | 0,01              |
| 100 000 0.250% Skandinaviska Enskilda Banken AB 20/06/2024              | 104 544          | 0,01              |
| 100 000 3.250% Skandinaviska Enskilda Banken AB 24/11/2025              | 106 972          | 0,01              |
| 100 000 0.375% Skandinaviska Enskilda Banken AB 09/02/2026              | 100 033          | 0,00              |
| 100 000 4.000% Skandinaviska Enskilda Banken AB 09/11/2026              | 108 307          | 0,01              |
| 100 000 1.750% Skandinaviska Enskilda Banken AB 11/11/2026              | 101 406          | 0,00              |
| 200 000 0.375% Skandinaviska Enskilda Banken AB 11/02/2027              | 188 727          | 0,01              |
| 200 000 0.750% Skandinaviska Enskilda Banken AB 09/08/2027              | 188 195          | 0,01              |
| 100 000 3.250% Slovenska Sporitelna AS 12/01/2026                       | 107 556          | 0,01              |
| 100 000 4.565% Smith & Nephew PLC 11/10/2029                            | 110 275          | 0,01              |
| 100 000 3.375% Snam SpA 05/12/2026                                      | 107 491          | 0,01              |
| 100 000 1.375% Snam SpA 25/10/2027                                      | 99 492           | 0,00              |
| 100 000 0.000% Snam SpA 07/12/2028                                      | 87 745           | 0,00              |
| 100 000 0.750% Snam SpA 17/06/2030                                      | 86 409           | 0,00              |
| 100 000 1.250% Snam SpA 20/06/2034                                      | 80 466           | 0,00              |
| 100 000 1.125% SNCF Reseau 25/05/2030                                   | 95 100           | 0,00              |
| 100 000 1.500% Societe Fonciere Lyonnaise SA 29/05/2025                 | 103 544          | 0,01              |
| 100 000 1.500% Societe Generale SA 30/05/2025                           | 105 523          | 0,01              |
| 100 000 0.125% Societe Generale SA 17/11/2026                           | 98 314           | 0,00              |
| 100 000 4.000% Societe Generale SA 16/11/2027                           | 109 183          | 0,01              |
| 100 000 0.625% Societe Generale SA 02/12/2027                           | 94 103           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Societe Generale SA 18/02/2028                           | 91 143           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 2.625% Societe Generale SA 30/05/2029                           | 102 045          | 0,01              |
| 100 000 0.500% Societe Generale SA 12/06/2029                           | 88 244           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Societe Generale SA 24/11/2030                           | 95 640           | 0,00              |
| 100 000 4.250% Societe Generale SA 16/11/2032                           | 111 618          | 0,01              |
| 100 000 0.500% Societe Generale SFH SA 30/01/2025                       | 103 088          | 0,01              |
| 100 000 0.010% Societe Generale SFH SA 02/12/2026                       | 96 709           | 0,00              |
| 100 000 0.750% Societe Generale SFH SA 19/01/2028                       | 96 933           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Societe Generale SFH SA 05/05/2028                       | 99 456           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Societe Generale SFH SA 02/02/2029                       | 91 100           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Societe Generale SFH SA 18/07/2029                       | 89 886           | 0,00              |
| 100 000 0.010% Societe Generale SFH SA 11/02/2030                       | 87 519           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Sodexo SA 17/07/2028                                     | 96 970           | 0,00              |
| 100 000 0.500% SpareBank 1 Boligkreditt AS 30/01/2025                   | 103 079          | 0,01              |
| 100 000 0.125% SpareBank 1 Boligkreditt AS 14/05/2026                   | 98 445           | 0,00              |
| 100 000 1.750% SpareBank 1 Boligkreditt AS 25/05/2027                   | 102 290          | 0,01              |
| 100 000 0.125% SpareBank 1 Boligkreditt AS 20/01/2028                   | 93 744           | 0,00              |
| 100 000 0.050% SpareBank 1 Boligkreditt AS 03/11/2028                   | 91 134           | 0,00              |
| 100 000 0.125% SpareBank 1 Boligkreditt AS 05/11/2029                   | 88 755           | 0,00              |
| 100 000 0.010% SpareBank 1 SMN 18/02/2028                               | 88 927           | 0,00              |
| 100 000 0.250% SpareBank 1 SR-Bank ASA 09/11/2026                       | 95 177           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Sparebanken Vest Boligkreditt AS 12/02/2026              | 100 338          | 0,00              |
| 200 000 1.000% SPP-Distribucia AS 09/06/2031                            | 139 780          | 0,01              |
| 100 000 0.010% SR-Boligkreditt AS 08/10/2026                            | 97 068           | 0,00              |
| 100 000 1.000% SR-Boligkreditt AS 01/04/2029                            | 95 520           | 0,00              |
| 100 000 0.010% SR-Boligkreditt AS 10/03/2031                            | 84 288           | 0,00              |
| 100 000 1.375% SSE PLC 04/09/2027                                       | 100 200          | 0,00              |
| 100 000 2.875% SSE PLC 01/08/2029                                       | 104 237          | 0,01              |
| 100 000 4.000% SSE PLC (Perpetual)                                      | 98 219           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Stadshypotek AB 11/07/2025                               | 101 889          | 0,00              |
| 200 000 0.125% Stadshypotek AB 05/10/2026                               | 194 840          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   | <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 500 000 0.010% Stadshypotek AB 24/11/2028                               | 454 294          | 0,02              | 100 000 1.750% Sveriges Sakerstallda Obligationer AB 10/02/2032         | 96 203           | 0,00              |
| 100 000 2.625% Stadshypotek AB 27/09/2029                               | 104 926          | 0,01              | 100 000 0.750% Swedbank AB 05/05/2025                                   | 101 950          | 0,01              |
| 100 000 0.010% Stadshypotek AB 30/09/2030                               | 85 709           | 0,00              | 100 000 0.300% Swedbank AB 20/05/2027                                   | 95 554           | 0,00              |
| 100 000 0.850% Standard Chartered PLC 27/01/2028                        | 94 754           | 0,00              | 100 000 0.200% Swedbank AB 12/01/2028                                   | 89 617           | 0,00              |
| 100 000 1.375% State Grid Overseas Investment BVI Ltd 02/05/2025        | 102 641          | 0,01              | 100 000 3.625% Swedbank AB 23/08/2032                                   | 100 825          | 0,00              |
| 100 000 0.797% State Grid Overseas Investment BVI Ltd 05/08/2026        | 98 333           | 0,00              | 100 000 0.050% Swedbank Hypotek AB 28/05/2025                           | 101 171          | 0,00              |
| 100 000 0.419% State Grid Overseas Investment BVI Ltd 08/09/2028        | 88 710           | 0,00              | 100 000 0.500% Swedbank Hypotek AB 05/02/2026                           | 100 425          | 0,00              |
| 100 000 1.303% State Grid Overseas Investment BVI Ltd 05/08/2032        | 82 418           | 0,00              | 100 000 1.375% Swedbank Hypotek AB 31/05/2027                           | 100 922          | 0,00              |
| 100 000 1.500% Statkraft AS 26/03/2030                                  | 95 868           | 0,00              | 100 000 3.375% Syngenta Finance NV 16/04/2026                           | 105 292          | 0,01              |
| 100 000 0.000% Stedin Holding NV 16/11/2026                             | 96 653           | 0,00              | 100 000 2.250% Takeda Pharmaceutical Co Ltd 21/11/2026                  | 103 791          | 0,01              |
| 200 000 0.500% Stedin Holding NV 14/11/2029                             | 179 923          | 0,01              | 100 000 1.000% Takeda Pharmaceutical Co Ltd 09/07/2029                  | 92 388           | 0,00              |
| 100 000 2.375% Stedin Holding NV 03/06/2030                             | 101 093          | 0,00              | 100 000 3.000% Takeda Pharmaceutical Co Ltd 21/11/2030                  | 102 964          | 0,01              |
| 100 000 2.750% Stellantis NV 15/05/2026                                 | 106 124          | 0,01              | 100 000 1.375% Takeda Pharmaceutical Co Ltd 09/07/2032                  | 87 821           | 0,00              |
| 100 000 0.625% Stellantis NV 30/03/2027                                 | 96 016           | 0,00              | 100 000 1.750% Talanx AG 01/12/2042                                     | 79 743           | 0,00              |
| 100 000 1.250% Stellantis NV 20/06/2033                                 | 81 451           | 0,00              | 100 000 2.500% TDF Infrastructure SASU 07/04/2026                       | 102 171          | 0,01              |
| 100 000 1.625% Stockland Trust 27/04/2026                               | 98 569           | 0,00              | 100 000 1.125% Telefonaktiebolaget LM Ericsson 08/02/2027               | 94 893           | 0,00              |
| 100 000 0.250% Stryker Corp 03/12/2024                                  | 103 042          | 0,01              | 100 000 1.000% Telefonaktiebolaget LM Ericsson 26/05/2029               | 85 107           | 0,00              |
| 100 000 2.125% Stryker Corp 30/11/2027                                  | 101 542          | 0,00              | 100 000 1.201% Telefonica Emisiones SA 21/08/2027                       | 98 605           | 0,00              |
| 100 000 5.125% Sudzucker International Finance BV 31/10/2027            | 111 403          | 0,01              | 100 000 0.250% Telenor ASA 14/02/2028                                   | 92 212           | 0,00              |
| 100 000 5.000% Suez SACA 03/11/2032                                     | 115 144          | 0,01              | 100 000 1.125% Telenor ASA 31/05/2029                                   | 93 532           | 0,00              |
| 100 000 0.010% Sumitomo Mitsui Banking Corp 10/09/2025                  | 99 387           | 0,00              | 150 000 1.750% Telenor ASA 31/05/2034                                   | 131 815          | 0,01              |
| 100 000 0.465% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 30/05/2024           | 104 481          | 0,01              | 200 000 3.750% Teleperformance 24/06/2029                               | 208 353          | 0,01              |
| 100 000 0.934% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 11/10/2024           | 103 922          | 0,01              | 100 000 2.125% Telia Co AB 20/02/2034                                   | 90 741           | 0,00              |
| 100 000 0.303% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 28/10/2027           | 90 875           | 0,00              | 100 000 4.625% Telia Co AB 21/12/2082                                   | 105 181          | 0,01              |
| 100 000 0.632% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 23/10/2029           | 86 880           | 0,00              | 100 000 1.375% Telstra Corp Ltd 26/03/2029                              | 94 828           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Svenska Handelsbanken AB 03/11/2026                      | 96 179           | 0,00              | 150 000 1.500% Temasek Financial I Ltd 01/03/2028                       | 149 752          | 0,01              |
| 100 000 3.750% Svenska Handelsbanken AB 01/11/2027                      | 108 552          | 0,01              | 100 000 1.625% TenneT Holding BV 17/11/2026                             | 103 754          | 0,01              |
| 100 000 0.050% Svenska Handelsbanken AB 06/09/2028                      | 89 296           | 0,00              | 100 000 3.875% TenneT Holding BV 28/10/2028                             | 111 238          | 0,01              |
| 100 000 1.375% Svenska Handelsbanken AB 23/02/2029                      | 92 694           | 0,00              | 100 000 2.125% TenneT Holding BV 17/11/2029                             | 101 778          | 0,00              |
| 100 000 0.500% Svenska Handelsbanken AB 18/02/2030                      | 85 221           | 0,00              | 100 000 0.500% TenneT Holding BV 09/06/2031                             | 89 554           | 0,00              |
| 500 000 0.375% Sveriges Sakerstallda Obligationer AB 05/06/2029         | 458 112          | 0,02              | 100 000 4.250% TenneT Holding BV 28/04/2032                             | 113 346          | 0,01              |
|   |                  |                   | 100 000 2.000% TenneT Holding BV 05/06/2034                             | 95 040           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 4.500% TenneT Holding BV 28/10/2034                             | 116 898          | 0,01              |
|   |                  |                   | 100 000 0.875% TenneT Holding BV 16/06/2035                             | 83 865           | 0,00              |



## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 1.500% TenneT Holding BV 03/06/2039                             | 83 673           | 0,00              |
| 100 000 1.125% TenneT Holding BV 09/06/2041                             | 77 537           | 0,00              |
| 100 000 0.625% Terega SASU 27/02/2028                                   | 91 614           | 0,00              |
| 50 000 4.900% Tema - Rete Elettrica Nazionale 28/10/2024                | 55 383           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Tema - Rete Elettrica Nazionale 26/07/2027               | 99 721           | 0,00              |
| 100 000 0.375% Tema - Rete Elettrica Nazionale 23/06/2029               | 89 135           | 0,00              |
| 100 000 1.250% Thames Water Utilities Finance PLC 31/01/2032            | 84 022           | 0,00              |
| 100 000 0.800% Thermo Fisher Scientific Finance I BV 18/10/2030         | 89 440           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Thermo Fisher Scientific Finance I BV 18/10/2033         | 84 713           | 0,00              |
| 100 000 3.200% Thermo Fisher Scientific Inc 21/01/2026                  | 108 159          | 0,01              |
| 100 000 1.450% Thermo Fisher Scientific Inc 16/03/2027                  | 101 238          | 0,00              |
| 100 000 0.875% Thermo Fisher Scientific Inc 01/10/2031                  | 87 282           | 0,00              |
| 100 000 2.375% Thermo Fisher Scientific Inc 15/04/2032                  | 98 204           | 0,00              |
| 100 000 3.650% Thermo Fisher Scientific Inc 21/11/2034                  | 108 024          | 0,01              |
| 100 000 1.300% Three Gorges Finance II Cayman Islands Ltd 21/06/2024    | 105 136          | 0,01              |
| 100 000 2.250% Tikehau Capital SCA 14/10/2026                           | 99 629           | 0,00              |
| 150 000 0.500% Toronto-Dominion Bank 03/04/2024                         | 158 307          | 0,01              |
| 200 000 1.707% Toronto-Dominion Bank 28/07/2025                         | 208 835          | 0,01              |
| 100 000 0.500% Toronto-Dominion Bank 18/01/2027                         | 95 114           | 0,00              |
| 100 000 0.864% Toronto-Dominion Bank 24/03/2027                         | 98 512           | 0,00              |
| 100 000 2.551% Toronto-Dominion Bank 03/08/2027                         | 101 930          | 0,01              |
| 100 000 3.631% Toronto-Dominion Bank 13/12/2029                         | 104 725          | 0,01              |
| 100 000 1.952% Toronto-Dominion Bank 08/04/2030                         | 94 081           | 0,00              |
| 100 000 3.129% Toronto-Dominion Bank 03/08/2032                         | 99 961           | 0,00              |
| 200 000 1.491% TotalEnergies Capital International SA 08/04/2027        | 202 351          | 0,01              |
| 100 000 0.696% TotalEnergies Capital International SA 31/05/2028        | 94 475           | 0,00              |
| 100 000 0.750% TotalEnergies Capital International SA 12/07/2028        | 94 497           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 1.491% TotalEnergies Capital International SA 04/09/2030        | 94 380           | 0,00              |
| 100 000 1.994% TotalEnergies Capital International SA 08/04/2032        | 95 085           | 0,00              |
| 100 000 3.369% TotalEnergies SE (Perpetual)                             | 102 849          | 0,01              |
| 100 000 1.625% TotalEnergies SE (Perpetual)                             | 89 831           | 0,00              |
| 100 000 2.000% TotalEnergies SE (Perpetual)                             | 94 120           | 0,00              |
| 100 000 2.125% TotalEnergies SE (Perpetual)                             | 78 562           | 0,00              |
| 500 000 0.064% Toyota Finance Australia Ltd 13/01/2025                  | 510 729          | 0,02              |
| 200 000 0.250% Toyota Motor Credit Corp 16/07/2026                      | 195 711          | 0,01              |
| 100 000 0.125% Toyota Motor Credit Corp 05/11/2027                      | 93 421           | 0,00              |
| 100 000 4.050% Toyota Motor Credit Corp 13/09/2029                      | 111 684          | 0,01              |
| 100 000 2.000% Transurban Finance Co Pty Ltd 28/08/2025                 | 104 051          | 0,01              |
| 100 000 3.000% Transurban Finance Co Pty Ltd 08/04/2030                 | 102 604          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Traton Finance Luxembourg SA 24/03/2029                  | 90 216           | 0,00              |
| 100 000 0.950% Tritax EuroBox PLC 02/06/2026                            | 90 779           | 0,00              |
| 100 000 0.000% Tyco Electronics Group SA 16/02/2029                     | 87 745           | 0,00              |
| 200 000 1.500% UBS Group AG 30/11/2024                                  | 207 295          | 0,01              |
| 200 000 2.750% UBS Group AG 15/06/2027                                  | 205 028          | 0,01              |
| 200 000 0.875% UBS Group AG 03/11/2031                                  | 157 679          | 0,01              |
| 100 000 0.875% Unibail-Rodamco-Westfield SE 21/02/2025                  | 102 176          | 0,01              |
| 100 000 1.375% Unibail-Rodamco-Westfield SE 09/03/2026                  | 99 481           | 0,00              |
| 100 000 0.750% Unibail-Rodamco-Westfield SE 25/10/2028                  | 86 424           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Unibail-Rodamco-Westfield SE 25/05/2033                  | 77 500           | 0,00              |
| 100 000 2.000% Unibail-Rodamco-Westfield SE 28/04/2036                  | 79 750           | 0,00              |
| 52 000 0.010% UniCredit Bank AG 10/09/2024                              | 53 828           | 0,00              |
| 100 000 0.625% UniCredit Bank AG 20/11/2025                             | 101 440          | 0,00              |
| 100 000 0.500% UniCredit Bank AG 23/02/2027                             | 98 151           | 0,00              |
| 50 000 0.010% UniCredit Bank AG 19/11/2027                              | 47 160           | 0,00              |
| 100 000 0.875% UniCredit Bank AG 11/01/2029                             | 95 914           | 0,00              |
| 100 000 0.010% UniCredit Bank AG 21/05/2029                             | 90 126           | 0,00              |
| 100 000 0.250% UniCredit Bank AG 15/01/2032                             | 85 147           | 0,00              |
| 200 000 0.375% UniCredit Bank AG 17/01/2033                             | 167 789          | 0,01              |
| 100 000 0.850% UniCredit Bank AG 22/05/2034                             | 85 392           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 0.625% UniCredit Bank Austria AG 16/01/2026                     | 100 717          | 0,00              |
| 100 000 0.250% UniCredit Bank Austria AG 04/06/2027                     | 96 000           | 0,00              |
| 100 000 0.250% UniCredit Bank Austria AG 21/06/2030                     | 88 119           | 0,00              |
| 100 000 1.250% UniCredit SpA 16/06/2026                                 | 101 813          | 0,00              |
| 150 000 5.850% UniCredit SpA 15/11/2027                                 | 166 486          | 0,01              |
| 100 000 0.925% UniCredit SpA 18/01/2028                                 | 95 320           | 0,00              |
| 100 000 0.850% UniCredit SpA 19/01/2031                                 | 81 191           | 0,00              |
| 100 000 1.625% UniCredit SpA 18/01/2032                                 | 84 324           | 0,00              |
| 100 000 1.750% Unilever Finance Netherlands BV 16/11/2028               | 100 193          | 0,00              |
| 156 000 1.375% Unilever Finance Netherlands BV 31/07/2029               | 151 490          | 0,01              |
| 100 000 1.750% Unilever Finance Netherlands BV 25/03/2030               | 98 084           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Unilever Finance Netherlands BV 04/09/2030               | 95 316           | 0,00              |
| 100 000 3.250% Unilever Finance Netherlands BV 23/02/2031               | 107 783          | 0,01              |
| 100 000 1.250% Unilever Finance Netherlands BV 28/02/2031               | 93 481           | 0,00              |
| 100 000 3.500% Unilever Finance Netherlands BV 23/02/2035               | 108 940          | 0,01              |
| 100 000 0.500% United Overseas Bank Ltd 16/01/2025                      | 102 951          | 0,01              |
| 100 000 0.010% United Overseas Bank Ltd 01/12/2027                      | 93 217           | 0,00              |
| 100 000 1.362% Upjohn Finance BV 23/06/2027                             | 96 126           | 0,00              |
| 100 000 1.908% Upjohn Finance BV 23/06/2032                             | 83 643           | 0,00              |
| 100 000 0.125% UPM-Kymmene Oyj 19/11/2028                               | 89 764           | 0,00              |
| 100 000 2.250% UPM-Kymmene Oyj 23/05/2029                               | 99 923           | 0,00              |
| 100 000 3.250% Urenco Finance NV 13/06/2032                             | 100 703          | 0,00              |
| 100 000 2.250% Utah Acquisition Sub Inc 22/11/2024                      | 105 725          | 0,01              |
| 100 000 0.375% Vantage Towers AG 31/03/2027                             | 108 645          | 0,01              |
| 50 000 5.375% Vattenfall AB 29/04/2024                                  | 55 661           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Vattenfall AB 24/06/2026                                 | 99 174           | 0,00              |
| 100 000 3.750% Vattenfall AB 18/10/2026                                 | 109 897          | 0,01              |
| 100 000 1.000% Veolia Environnement SA 03/04/2025                       | 103 543          | 0,01              |
| 100 000 0.000% Veolia Environnement SA 09/06/2026                       | 97 702           | 0,00              |
| 100 000 0.000% Veolia Environnement SA 14/01/2027                       | 95 055           | 0,00              |
| 100 000 1.590% Veolia Environnement SA 10/01/2028                       | 100 227          | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 0.800% Veolia Environnement SA 15/01/2032                       | 85 563           | 0,00              |
| 100 000 2.875% Veolia Environnement SA (Perpetual)                      | 106 083          | 0,01              |
| 100 000 0.875% Verizon Communications Inc 02/04/2025                    | 103 135          | 0,01              |
| 100 000 0.875% Verizon Communications Inc 08/04/2027                    | 98 241           | 0,00              |
| 100 000 0.375% Verizon Communications Inc 22/03/2029                    | 89 230           | 0,00              |
| 100 000 1.875% Verizon Communications Inc 26/10/2029                    | 97 078           | 0,00              |
| 100 000 4.250% Verizon Communications Inc 31/10/2030                    | 112 287          | 0,01              |
| 100 000 1.300% Verizon Communications Inc 18/05/2033                    | 85 178           | 0,00              |
| 100 000 4.750% Verizon Communications Inc 31/10/2034                    | 115 813          | 0,01              |
| 100 000 1.125% Verizon Communications Inc 19/09/2035                    | 78 715           | 0,00              |
| 100 000 2.875% Verizon Communications Inc 15/01/2038                    | 93 700           | 0,00              |
| 100 000 1.500% Verizon Communications Inc 19/09/2039                    | 74 313           | 0,00              |
| 100 000 1.850% Verizon Communications Inc 18/05/2040                    | 76 948           | 0,00              |
| 100 000 2.000% Vestas Wind Systems Finance BV 15/06/2034                | 87 528           | 0,00              |
| 100 000 2.000% Vesteda Finance BV 10/07/2026                            | 101 298          | 0,00              |
| 100 000 1.500% Vesteda Finance BV 24/05/2027                            | 97 523           | 0,00              |
| 100 000 4.250% VF Corp 07/03/2029                                       | 108 347          | 0,01              |
| 100 000 0.625% VF Corp 25/02/2032                                       | 79 593           | 0,00              |
| 100 000 1.625% VGP NV 17/01/2027  | 84 501           | 0,00              |
| 100 000 1.750% VIA Outlets BV 15/11/2028                                | 84 813           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Vicinity Centres Trust 07/11/2029                        | 86 311           | 0,00              |
| 100 000 4.000% Vier Gas Transport GmbH 26/09/2027                       | 109 170          | 0,01              |
| 100 000 1.500% Vier Gas Transport GmbH 25/09/2028                       | 96 288           | 0,00              |
| 100 000 0.000% Vinci SA 27/11/2028                                      | 92 249           | 0,00              |
| 100 000 1.625% Vinci SA 18/01/2029                                      | 98 809           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Vinci SA 09/01/2032                                      | 84 646           | 0,00              |
| 100 000 1.500% Visa Inc 15/06/2026                                      | 102 407          | 0,01              |
| 100 000 2.000% Visa Inc 15/06/2029                                      | 100 789          | 0,00              |
| 100 000 2.200% Vodafone Group PLC 25/08/2026                            | 104 916          | 0,01              |
| 100 000 1.500% Vodafone Group PLC 24/07/2027                            | 100 377          | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   | <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 1.875% Vodafone Group PLC<br>20/11/2029                         | 96 663           | 0,00              | 100 000 1.250% Vonovia Finance BV 06/12/2024                            | 103 035          | 0,01              |
| 100 000 1.600% Vodafone Group PLC<br>29/07/2031                         | 91 853           | 0,00              | 100 000 0.000% Vonovia SE 01/12/2025                                    | 95 736           | 0,00              |
| 100 000 2.875% Vodafone Group PLC<br>20/11/2037                         | 93 246           | 0,00              | 200 000 4.750% Vonovia SE 23/05/2027                                    | 212 646          | 0,01              |
| 100 000 2.500% Volkswagen Bank GmbH<br>31/07/2026                       | 103 445          | 0,01              | 100 000 0.375% Vonovia SE 16/06/2027                                    | 88 561           | 0,00              |
| 100 000 0.250% Volkswagen Financial Services<br>AG 31/01/2025           | 102 166          | 0,01              | 100 000 1.875% Vonovia SE 28/06/2028                                    | 92 604           | 0,00              |
| 40 000 0.000% Volkswagen Financial Services<br>AG 12/02/2025            | 40 634           | 0,00              | 100 000 5.000% Vonovia SE 23/11/2030                                    | 101 625          | 0,00              |
| 65 000 0.125% Volkswagen Financial Services<br>AG 12/02/2027            | 60 941           | 0,00              | 200 000 1.500% Vonovia SE 14/06/2041                                    | 114 542          | 0,01              |
| 70 000 0.875% Volkswagen Financial Services<br>AG 31/01/2028            | 65 283           | 0,00              | 200 000 1.625% Vonovia SE 01/09/2051                                    | 99 712           | 0,00              |
| 100 000 0.375% Volkswagen Financial Services<br>AG 12/02/2030           | 83 893           | 0,00              | 100 000 0.010% Vseobecna Uverova Banka AS<br>23/06/2025                 | 100 222          | 0,00              |
| 100 000 0.050% Volkswagen International<br>Finance NV 10/06/2024        | 104 187          | 0,01              | 100 000 1.250% Wabtec Transportation<br>Netherlands BV 03/12/2027       | 95 123           | 0,00              |
| 100 000 4.125% Volkswagen International<br>Finance NV 15/11/2025        | 109 302          | 0,01              | 200 000 0.500% Wells Fargo & Co 26/04/2024                              | 209 946          | 0,01              |
| 100 000 1.875% Volkswagen International<br>Finance NV 30/03/2027        | 99 977           | 0,00              | 100 000 1.338% Wells Fargo & Co 04/05/2025                              | 105 329          | 0,01              |
| 100 000 0.875% Volkswagen International<br>Finance NV 22/09/2028        | 92 693           | 0,00              | 200 000 2.000% Wells Fargo & Co 27/04/2026                              | 205 489          | 0,01              |
| 100 000 4.375% Volkswagen International<br>Finance NV 15/05/2030        | 109 675          | 0,01              | 100 000 1.000% Wells Fargo & Co 02/02/2027                              | 97 087           | 0,00              |
| 100 000 4.125% Volkswagen International<br>Finance NV 16/11/2038        | 102 847          | 0,01              | 200 000 0.625% Wells Fargo & Co 25/03/2030                              | 171 164          | 0,01              |
| 100 000 3.500% Volkswagen International<br>Finance NV (Perpetual)       | 90 750           | 0,00              | 100 000 1.741% Wells Fargo & Co 04/05/2030                              | 93 906           | 0,00              |
| 100 000 3.375% Volkswagen International<br>Finance NV (Perpetual)       | 104 837          | 0,01              | 100 000 0.954% Wesfarmers Ltd 21/10/2033                                | 80 696           | 0,00              |
| 100 000 3.500% Volkswagen International<br>Finance NV (Perpetual)       | 102 453          | 0,01              | 100 000 3.799% Westpac Banking Corp<br>17/01/2030                       | 108 033          | 0,01              |
| 100 000 3.875% Volkswagen International<br>Finance NV (Perpetual)       | 98 049           | 0,00              | 100 000 0.766% Westpac Banking Corp<br>13/05/2031                       | 94 804           | 0,00              |
| 100 000 4.375% Volkswagen International<br>Finance NV (Perpetual)       | 90 889           | 0,00              | 200 000 1.375% Westpac Banking Corp<br>17/05/2032                       | 182 306          | 0,01              |
| 100 000 4.625% Volkswagen International<br>Finance NV (Perpetual)       | 98 907           | 0,00              | 100 000 1.250% Westpac Banking Corp<br>14/01/2033                       | 88 891           | 0,00              |
| 55 000 0.250% Volkswagen Leasing GmbH<br>12/01/2026                     | 54 208           | 0,00              | 200 000 0.427% Westpac Securities NZ Ltd/<br>London 14/12/2026          | 191 585          | 0,01              |
| 100 000 1.500% Volkswagen Leasing GmbH<br>19/06/2026                    | 101 026          | 0,00              | 100 000 1.100% Whirlpool Finance Luxembourg<br>Sarl 09/11/2027          | 96 022           | 0,00              |
| 100 000 0.375% Volkswagen Leasing GmbH<br>20/07/2026                    | 97 084           | 0,00              | 200 000 1.332% Wintershall Dea Finance BV<br>25/09/2028                 | 181 624          | 0,01              |
| 135 000 0.500% Volkswagen Leasing GmbH<br>12/01/2029                    | 119 007          | 0,01              | 100 000 2.625% Wirtschafts- und<br>Infrastrukturbank Hessen 26/01/2033  | 105 303          | 0,01              |
| 300 000 0.000% Volvo Treasury AB 18/05/2026                             | 292 061          | 0,01              | 250 000 1.350% WPC Eurobond BV 15/04/2028                               | 223 993          | 0,01              |
|   |                  |                   | 100 000 0.950% WPC Eurobond BV 01/06/2030                               | 80 233           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 1.375% WPP Finance 2016 20/03/2025                              | 103 510          | 0,01              |
|   |                  |                   | 100 000 0.125% Wuestenrot Bausparkasse AG<br>19/10/2029                 | 89 879           | 0,00              |
|   |                  |                   | 50 000 0.750% Wurth Finance International BV<br>22/11/2027              | 48 064           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 2.125% Wurth Finance International BV<br>23/08/2030             | 97 144           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 2.425% Zimmer Biomet Holdings Inc<br>13/12/2026                 | 103 614          | 0,01              |
|   |                  |                   | 100 000 1.164% Zimmer Biomet Holdings Inc<br>15/11/2027                 | 96 593           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|---|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                    |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Euro – 7,84 % (suite)</b>  |                    |                   |
| 200 000 0.000% Zuercher Kantonalbank 15/05/2026                         | 195 181            | 0,01              |
| 200 000 2.020% Zuercher Kantonalbank 13/04/2028                         | 197 795            | 0,01              |
| 100 000 1.875% Zurich Finance Ireland Designated Activity Co 17/09/2050 | 85 469             | 0,00              |
|   | <b>208 766 895</b> | <b>7,84</b>       |
| <b>Livre sterling – 0,97 %</b>  |                    |                   |
| 100 000 3.250% AA Bond Co Ltd 31/07/2050                                | 98 567             | 0,00              |
| 100 000 3.375% Abertis Infraestructuras SA 27/11/2026                   | 114 980            | 0,01              |
| 100 000 6.250% ABP Finance PLC 14/12/2026                               | 126 357            | 0,01              |
| 50 000 6.625% Aegon NV 16/12/2039                                       | 70 624             | 0,00              |
| 100 000 2.893% Affordable Housing Finance PLC 11/08/2045                | 100 328            | 0,00              |
| 100 000 5.000% America Movil SAB de CV 27/10/2026                       | 123 003            | 0,01              |
| 50 000 6.625% Anglian Water Services Financing PLC 15/01/2029           | 66 811             | 0,00              |
| 200 000 3.935% Annington Funding PLC 12/07/2047                         | 173 249            | 0,01              |
| 100 000 3.125% APA Infrastructure Ltd 18/07/2031                        | 101 817            | 0,00              |
| 100 000 4.750% Aroundtown SA (Perpetual)                                | 43 271             | 0,00              |
| 100 000 1.125% Asian Development Bank 10/06/2025                        | 115 821            | 0,01              |
| 100 000 0.250% Asian Development Bank 28/10/2027                        | 104 570            | 0,00              |
| 50 000 0.750% Asian Development Bank 07/12/2027                         | 53 396             | 0,00              |
| 100 000 0.200% Asian Infrastructure Investment Bank 15/12/2025          | 110 582            | 0,00              |
| 120 876 4.674% Aspire Defence Finance PLC 31/03/2040                    | 144 023            | 0,00              |
| 100 000 2.500% Associated British Foods PLC 16/06/2034                  | 100 450            | 0,00              |
| 100 000 1.405% Aster Treasury Plc 27/01/2036                            | 85 058             | 0,00              |
| 100 000 5.500% AT&T Inc 15/03/2027                                      | 124 487            | 0,01              |
| 50 000 7.000% AT&T Inc 30/04/2040                                       | 69 944             | 0,00              |
| 100 000 4.000% Aviva PLC 03/06/2055                                     | 96 490             | 0,00              |
| 100 000 1.750% Banco Santander SA 17/02/2027                            | 105 984            | 0,00              |
| 100 000 4.750% Banco Santander SA 30/08/2028                            | 119 916            | 0,01              |
| 100 000 2.250% Banco Santander SA 04/10/2032                            | 99 824             | 0,00              |
| 100 000 1.667% Bank of America Corp 02/06/2029                          | 102 789            | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Livre sterling – 0,97 % (suite)</b>                                  |                  |                   |
| 100 000 3.584% Bank of America Corp 27/04/2031                          | 110 260          | 0,00              |
| 100 000 4.875% Banque Federative du Credit Mutuel SA 25/09/2025         | 122 507          | 0,01              |
| 100 000 1.875% Banque Federative du Credit Mutuel SA 26/10/2028         | 105 285          | 0,00              |
| 200 000 3.750% Barclays PLC 22/11/2030                                  | 225 662          | 0,01              |
| 100 000 8.407% Barclays PLC 14/11/2032                                  | 127 755          | 0,01              |
| 100 000 2.250% BAT International Finance PLC 26/06/2028                 | 101 525          | 0,00              |
| 100 000 6.000% BAT International Finance PLC 24/11/2034                 | 112 012          | 0,01              |
| 50 000 5.750% BAT International Finance PLC 05/07/2040                  | 51 715           | 0,00              |
| 100 000 2.500% Berkeley Group PLC 11/08/2031                            | 86 155           | 0,00              |
| 100 000 2.375% Berkshire Hathaway Finance Corp 19/06/2039               | 89 299           | 0,00              |
| 100 000 5.125% BG Energy Capital PLC 01/12/2025                         | 124 633          | 0,01              |
| 100 000 4.875% Blackstone Private Credit Fund 14/04/2026                | 113 203          | 0,01              |
| 100 000 3.375% BNP Paribas SA 23/01/2026                                | 117 183          | 0,01              |
| 100 000 2.875% BNP Paribas SA 24/02/2029                                | 106 342          | 0,00              |
| 100 000 1.250% BNP Paribas SA 13/07/2031                                | 88 304           | 0,00              |
| 100 000 5.750% BNP Paribas SA 13/06/2032                                | 124 561          | 0,01              |
| 100 000 1.000% BPCE SA 22/12/2025                                       | 110 801          | 0,00              |
| 100 000 5.250% BPCE SA 16/04/2029                                       | 114 605          | 0,01              |
| 50 000 6.375% British Telecommunications PLC 23/06/2037                 | 63 750           | 0,00              |
| 50 000 4.821% Broadgate Financing PLC 05/07/2033                        | 60 181           | 0,00              |
| 100 000 2.600% Brown-Forman Corp 07/07/2028                             | 112 615          | 0,01              |
| 100 000 4.125% BUPA Finance PLC 14/06/2035                              | 97 670           | 0,00              |
| 100 000 2.625% Cadent Finance PLC 22/09/2038                            | 84 973           | 0,00              |
| 100 000 3.125% Catalyst Housing Ltd 31/10/2047                          | 86 845           | 0,00              |
| 100 000 4.250% Centrica PLC 12/09/2044                                  | 98 598           | 0,00              |
| 100 000 1.750% Citigroup Inc 23/10/2026                                 | 109 630          | 0,00              |
| 50 000 6.800% Citigroup Inc 25/06/2038                                  | 73 265           | 0,00              |
| 50 000 7.375% Citigroup Inc 01/09/2039                                  | 77 452           | 0,00              |
| 100 000 2.625% Clarion Funding PLC 18/01/2029                           | 108 991          | 0,00              |
| 100 000 1.875% Clarion Funding PLC 22/01/2035                           | 87 814           | 0,00              |
| 100 000 5.500% Comcast Corp 23/11/2029                                  | 129 020          | 0,01              |
| 200 000 1.875% Comcast Corp 20/02/2036                                  | 177 418          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Livre sterling – 0,97 % (suite)</b>                                  |                  |                   |
| 100 000 5.017% Community Finance Co 1 PLC<br>31/07/2034                 | 125 125          | 0,01              |
| 100 000 2.000% Compass Group PLC<br>05/09/2025                          | 116 717          | 0,01              |
| 100 000 1.875% Cooperatieve Rabobank UA<br>12/07/2028                   | 107 445          | 0,00              |
| 100 000 3.690% CPMK Finance Ltd 28/02/2047                              | 110 170          | 0,00              |
| 100 000 4.875% Credit Agricole SA 23/10/2029                            | 121 900          | 0,01              |
| 100 000 2.250% Credit Suisse Group AG<br>09/06/2028                     | 103 784          | 0,00              |
| 61 441 5.546% Delamare Finance PLC<br>19/02/2029                        | 75 420           | 0,00              |
| 100 000 1.875% Derwent London PLC<br>17/11/2031                         | 89 937           | 0,00              |
| 100 000 2.625% Deutsche Bank AG 16/12/2024                              | 114 184          | 0,01              |
| 100 000 4.000% Deutsche Bank AG 24/06/2026                              | 115 813          | 0,01              |
| 100 000 2.125% Dexia Credit Local SA<br>12/02/2025                      | 118 177          | 0,01              |
| 100 000 1.250% Diageo Finance PLC<br>28/03/2033                         | 90 858           | 0,00              |
| 100 000 3.750% Digital Stout Holding LLC<br>17/10/2030                  | 106 895          | 0,00              |
| 100 000 2.625% DNB Bank ASA 10/06/2026                                  | 117 104          | 0,01              |
| 50 000 5.875% E.ON International Finance BV<br>30/10/2037               | 63 007           | 0,00              |
| 50 000 6.125% E.ON International Finance BV<br>06/07/2039               | 64 606           | 0,00              |
| 50 000 4.750% East Japan Railway Co<br>08/12/2031                       | 61 500           | 0,00              |
| 50 000 5.250% East Japan Railway Co<br>22/04/2033                       | 63 980           | 0,00              |
| 200 000 6.125% Electricite de France SA<br>02/06/2034                   | 251 909          | 0,01              |
| 100 000 5.500% Electricite de France SA<br>17/10/2041                   | 113 589          | 0,01              |
| 50 000 7.000% Engie SA 30/10/2028                                       | 67 145           | 0,00              |
| 200 000 0.750% European Investment Bank<br>15/11/2024                   | 233 130          | 0,01              |
| 200 000 1.375% European Investment Bank<br>07/03/2025                   | 233 726          | 0,01              |
| 50 000 1.125% European Investment Bank<br>19/06/2025                    | 57 952           | 0,00              |
| 200 000 0.125% European Investment Bank<br>14/12/2026                   | 213 978          | 0,01              |
| 100 000 0.750% European Investment Bank<br>22/07/2027                   | 108 030          | 0,00              |
| 100 000 5.625% European Investment Bank<br>07/06/2032                   | 141 007          | 0,01              |
| 50 000 3.875% European Investment Bank<br>08/06/2037                    | 60 760           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Livre sterling – 0,97 % (suite)</b>                                  |                  |                   |
| 89 744 2.742% Eversholt Funding PLC<br>30/06/2040                       | 89 678           | 0,00              |
| 100 000 0.739% Experian Finance PLC<br>29/10/2025                       | 111 909          | 0,01              |
| 100 000 3.250% Experian Finance PLC<br>07/04/2032                       | 109 663          | 0,00              |
| 100 000 3.360% Fidelity National Information<br>Services Inc 21/05/2031 | 108 060          | 0,00              |
| 100 000 3.250% Gatwick Funding Ltd<br>26/02/2048                        | 84 139           | 0,00              |
| 100 000 5.875% GE Capital UK Funding<br>Unlimited Co 18/01/2033         | 127 469          | 0,01              |
| 100 000 1.250% GlaxoSmithKline Capital PLC<br>12/10/2028                | 104 319          | 0,00              |
| 100 000 1.625% GlaxoSmithKline Capital PLC<br>12/05/2035                | 88 833           | 0,00              |
| 100 000 4.250% GlaxoSmithKline Capital PLC<br>18/12/2045                | 111 235          | 0,01              |
| 100 000 1.500% Goldman Sachs Group Inc<br>07/12/2027                    | 104 735          | 0,00              |
| 100 000 7.250% Goldman Sachs Group Inc<br>10/04/2028                    | 133 415          | 0,01              |
| 50 000 3.625% Goldman Sachs Group Inc<br>29/10/2029                     | 55 739           | 0,00              |
| 150 000 6.875% Goldman Sachs Group Inc<br>18/01/2038                    | 194 071          | 0,01              |
| 67 283 4.137% Greater Gabbard OFTO PLC<br>29/11/2032                    | 79 286           | 0,00              |
| 68 950 4.064% Greene King Finance PLC<br>15/03/2035                     | 73 235           | 0,00              |
| 100 000 5.875% Heathrow Funding Ltd<br>13/05/2043                       | 126 847          | 0,01              |
| 100 000 4.375% High Speed Rail Finance 1 PLC<br>01/11/2038              | 113 905          | 0,01              |
| 100 000 3.000% Holcim Sterling Finance<br>Netherlands BV 12/05/2032     | 102 498          | 0,00              |
| 100 000 2.250% Holcim Sterling Finance<br>Netherlands BV 04/04/2034     | 90 582           | 0,00              |
| 100 000 2.256% HSBC Holdings PLC<br>13/11/2026                          | 112 681          | 0,01              |
| 200 000 1.750% HSBC Holdings PLC<br>24/07/2027                          | 216 616          | 0,01              |
| 50 000 5.750% HSBC Holdings PLC<br>20/12/2027                           | 60 785           | 0,00              |
| 100 000 3.000% HSBC Holdings PLC<br>29/05/2030                          | 105 031          | 0,00              |
| 100 000 8.201% HSBC Holdings PLC<br>16/11/2034                          | 130 182          | 0,01              |
| 50 000 7.000% HSBC Holdings PLC<br>07/04/2038                           | 62 444           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>             |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Livre sterling – 0,97 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 3.125% IG Group Holdings PLC 18/11/2028                               | 95 444           | 0,00              |
| 100 000 1.250% Inter-American Development Bank 15/12/2025                     | 114 160          | 0,01              |
| 100 000 2.125% Inter-American Development Bank 15/12/2028                     | 112 212          | 0,01              |
| 100 000 0.250% International Bank for Reconstruction & Development 23/09/2027 | 104 847          | 0,00              |
| 100 000 0.625% International Bank for Reconstruction & Development 14/07/2028 | 104 108          | 0,00              |
| 100 000 1.250% International Bank for Reconstruction & Development 13/12/2028 | 106 899          | 0,00              |
| 100 000 1.000% International Bank for Reconstruction & Development 21/12/2029 | 102 925          | 0,00              |
| 100 000 0.750% International Development Association 12/12/2024               | 116 098          | 0,01              |
| 100 000 0.750% International Development Association 21/09/2028               | 103 799          | 0,00              |
| 100 000 0.250% International Finance Corp 15/12/2025                          | 111 166          | 0,01              |
| 100 000 0.991% JPMorgan Chase & Co 28/04/2026                                 | 112 966          | 0,01              |
| 100 000 2.750% JT International Financial Services BV 28/09/2033              | 95 360           | 0,00              |
| 35 076 5.064% Juturna European Loan Conduit No 16 PLC 10/08/2033              | 43 469           | 0,00              |
| 200 000 0.875% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 18/07/2024                     | 235 858          | 0,01              |
| 100 000 1.375% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 09/12/2024                     | 117 390          | 0,01              |
| 100 000 1.125% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 04/07/2025                     | 115 786          | 0,01              |
| 100 000 3.875% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 02/09/2025                     | 122 468          | 0,01              |
| 100 000 1.375% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/12/2025                     | 114 676          | 0,01              |
| 100 000 0.875% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 15/09/2026                     | 110 938          | 0,01              |
| 200 000 0.125% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 30/12/2026                     | 213 208          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 07/12/2027                     | 106 955          | 0,00              |
| 100 000 5.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 09/06/2036                     | 136 709          | 0,01              |
| 100 000 5.625% La Banque Postale SA 21/09/2028                                | 121 396          | 0,01              |
| 100 000 2.399% Land Securities Capital Markets PLC 08/02/2031                 | 107 959          | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Livre sterling – 0,97 % (suite)</b>                                  |                  |                   |
| 100 000 1.375% Landwirtschaftliche Rentenbank 08/09/2025                | 115 315          | 0,01              |
| 100 000 1.250% Landwirtschaftliche Rentenbank 22/07/2027                | 110 208          | 0,00              |
| 100 000 2.125% Landwirtschaftliche Rentenbank 15/12/2028                | 111 974          | 0,01              |
| 100 000 5.125% Legal & General Group PLC 14/11/2048                     | 116 098          | 0,01              |
| 100 000 3.750% Legal & General Group PLC 26/11/2049                     | 103 922          | 0,00              |
| 100 000 4.500% Legal & General Group PLC 01/11/2050                     | 107 433          | 0,00              |
| 100 000 1.750% Lloyds Bank Corporate Markets PLC 11/07/2024             | 117 999          | 0,01              |
| 100 000 5.125% Lloyds Bank PLC 07/03/2025                               | 124 601          | 0,01              |
| 142 000 2.707% Lloyds Banking Group PLC 03/12/2035                      | 135 859          | 0,01              |
| 100 000 3.125% London & Quadrant Housing Trust 28/02/2053               | 82 778           | 0,00              |
| 100 000 2.625% London Power Networks PLC 01/03/2029                     | 108 097          | 0,00              |
| 100 000 5.625% M&G PLC 20/10/2051                                       | 112 555          | 0,01              |
| 100 000 5.560% M&G PLC 20/07/2055                                       | 107 943          | 0,00              |
| 100 000 6.250% M&G PLC 20/10/2068                                       | 105 782          | 0,00              |
| 100 000 2.875% Manchester Airport Group Funding PLC 30/09/2044          | 82 599           | 0,00              |
| 27 501 4.986% Meadowhall Finance PLC 12/07/2037                         | 31 398           | 0,00              |
| 100 000 1.625% Mercedes-Benz International Finance BV 11/11/2024        | 117 669          | 0,01              |
| 100 000 4.125% Metropolitan Life Global Funding I 02/09/2025            | 120 959          | 0,01              |
| 100 000 1.625% Metropolitan Life Global Funding I 12/10/2028            | 104 580          | 0,00              |
| 100 000 1.625% Metropolitan Life Global Funding I 21/09/2029            | 101 563          | 0,00              |
| 100 000 5.789% Morgan Stanley 18/11/2033                                | 125 842          | 0,01              |
| 100 000 3.750% Motability Operations Group PLC 16/07/2026               | 120 773          | 0,01              |
| 100 000 3.625% Motability Operations Group PLC 10/03/2036               | 110 283          | 0,00              |
| 100 000 2.375% Motability Operations Group PLC 03/07/2039               | 88 938           | 0,00              |
| 100 000 2.125% Motability Operations Group PLC 18/01/2042               | 81 959           | 0,00              |
| 100 000 1.699% National Australia Bank Ltd 15/09/2031                   | 103 396          | 0,00              |
| 100 000 3.500% National Grid Electricity Distribution PLC 16/10/2026    | 116 566          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Livre sterling – 0,97 % (suite)</b>                                  |                  |                   |
| 100 000 2.000% National Grid Electricity Transmission PLC 17/04/2040    | 77 701           | 0,00              |
| 100 000 1.750% Nats En Route PLC 30/09/2033                             | 91 558           | 0,00              |
| 100 000 2.875% NatWest Group PLC 19/09/2026                             | 115 152          | 0,01              |
| 100 000 2.057% NatWest Group PLC 09/11/2028                             | 105 721          | 0,00              |
| 100 000 6.375% NatWest Markets PLC 08/11/2027                           | 128 465          | 0,01              |
| 100 000 1.375% Nestle Holdings Inc 23/06/2033                           | 92 467           | 0,00              |
| 100 000 0.750% New York Life Global Funding 24/12/2028                  | 99 882           | 0,00              |
| 100 000 3.250% Northern Powergrid Northeast PLC 01/04/2052              | 90 759           | 0,00              |
| 100 000 1.625% Northumbrian Water Finance PLC 11/10/2026                | 109 558          | 0,00              |
| 100 000 6.375% Northumbrian Water Finance PLC 28/10/2034                | 132 959          | 0,01              |
| 100 000 2.000% Notting Hill Genesis 03/06/2036                          | 86 359           | 0,00              |
| 100 000 3.250% Notting Hill Genesis 12/10/2048                          | 87 687           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Oesterreichische Kontrollbank AG 15/12/2025              | 111 616          | 0,01              |
| 50 000 5.250% Orange SA 05/12/2025                                      | 62 511           | 0,00              |
| 50 000 8.125% Orange SA 20/11/2028                                      | 71 425           | 0,00              |
| 50 000 5.625% Orange SA 23/01/2034                                      | 64 965           | 0,00              |
| 50 000 5.750% Orsted AS 09/04/2040                                      | 64 185           | 0,00              |
| 100 000 2.750% Peabody Capital No 2 Plc 02/03/2034                      | 100 326          | 0,00              |
| 100 000 3.550% PepsiCo Inc 22/07/2034                                   | 112 153          | 0,01              |
| 100 000 5.867% Phoenix Group Holdings PLC 13/06/2029                    | 114 828          | 0,01              |
| 100 000 2.875% Places For People Treasury PLC 17/08/2026                | 114 715          | 0,01              |
| 100 000 1.625% Platform HG Financing PLC 10/08/2055                     | 59 890           | 0,00              |
| 100 000 2.250% Prologis LP 30/06/2029                                   | 105 138          | 0,00              |
| 200 000 2.000% Prs Finance PLC 23/01/2029                               | 218 634          | 0,01              |
| 100 000 3.375% Quadgas Finance PLC 17/09/2029                           | 102 507          | 0,00              |
| 200 000 4.870% RAC Bond Co PLC 06/05/2046                               | 228 506          | 0,01              |
| 100 000 1.875% Realty Income Corp 14/01/2027                            | 108 920          | 0,00              |
| 100 000 1.750% Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 19/05/2032       | 98 878           | 0,00              |
| 100 000 1.625% Sage Group PLC 25/02/2031                                | 95 842           | 0,00              |
| 100 000 2.875% Sage Group PLC 08/02/2034                                | 99 391           | 0,00              |
| 100 000 2.375% Sanctuary Capital PLC 14/04/2050                         | 74 852           | 0,00              |
| 100 000 5.250% Santander UK PLC 16/02/2029                              | 128 593          | 0,01              |
| 100 000 3.250% Scotland Gas Networks PLC 08/03/2027                     | 115 383          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                     |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>               |                  |                   |
| <b>Livre sterling – 0,97 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 3.625% Severn Trent Utilities Finance PLC 16/01/2026                          | 118 974          | 0,01              |
| 100 000 1.000% Shell International Finance BV 10/12/2030                              | 94 919           | 0,00              |
| 100 000 1.750% Shell International Finance BV 10/09/2052                              | 60 497           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Siemens Financieringsmaatschappij NV 20/02/2025                        | 115 661          | 0,01              |
| 50 000 6.000% Sky Ltd 21/05/2027  | 64 652           | 0,00              |
| 100 000 4.000% Sky Ltd 26/11/2029   | 118 577          | 0,01              |
| 50 000 4.625% Southern Electric Power Distribution PLC 20/02/2037                     | 57 069           | 0,00              |
| 100 000 2.375% Southern Housing Group Ltd 08/10/2036                                  | 91 037           | 0,00              |
| 100 000 2.375% Southern Water Services Finance Ltd 28/05/2028                         | 106 929          | 0,00              |
| 50 000 6.192% Southern Water Services Finance Ltd 31/03/2029                          | 64 666           | 0,00              |
| 100 000 3.000% Southern Water Services Finance Ltd 28/05/2037                         | 90 862           | 0,00              |
| 100 000 5.125% Standard Chartered PLC 06/06/2034                                      | 108 894          | 0,00              |
| 100 000 7.272% Swedbank AB 15/11/2032   | 126 685          | 0,01              |
| 88 726 3.158% TC Dudgeon Ofco PLC 12/11/2038  | 94 932           | 0,00              |
| 100 000 5.375% Telefonica Emisiones SA 02/02/2026                                     | 124 201          | 0,01              |
| 86 500 6.165% Telereal Securitisation PLC 10/12/2033                                  | 107 103          | 0,00              |
| 100 000 2.500% Tesco Corporate Treasury Services PLC 02/05/2025                       | 117 677          | 0,01              |
| 91 582 5.744% Tesco Property Finance 3 PLC 13/04/2040                                 | 111 967          | 0,01              |
| 50 000 6.750% Thames Water Utilities Finance PLC 16/11/2028                           | 65 997           | 0,00              |
| 100 000 4.375% Thames Water Utilities Finance PLC 03/07/2034                          | 111 731          | 0,01              |
| 100 000 2.375% Thames Water Utilities Finance PLC 22/04/2040                          | 79 160           | 0,00              |
| 100 000 0.750% Toyota Motor Finance Netherlands BV 19/12/2025                         | 111 649          | 0,01              |
| 100 000 2.625% TP ICAP Finance PLC 18/11/2028   | 96 437           | 0,00              |
| 100 000 2.125% Transport for London 24/04/2025  | 116 224          | 0,01              |
| 100 000 1.625% UK Municipal Bonds Agency Finance Co Designated Activity Co 26/08/2060 | 57 654           | 0,00              |
| 100 000 3.921% UNITE USAF II PLC 30/06/2030   | 118 976          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                   |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Livre sterling – 0,97 % (suite)</b>                                  |                   |                   |
| 100 000 1.750% United Utilities Water Finance PLC 10/02/2038            | 80 997            | 0,00              |
| 100 000 2.544% University of Oxford 08/12/2117                          | 67 856            | 0,00              |
| 100 000 4.000% Utmost Group PLC 15/12/2031                              | 91 757            | 0,00              |
| 100 000 5.375% Veolia Environnement SA 02/12/2030                       | 126 727           | 0,01              |
| 100 000 1.125% Verizon Communications Inc 03/11/2028                    | 100 959           | 0,00              |
| 100 000 1.875% Verizon Communications Inc 03/11/2038                    | 78 707            | 0,00              |
| 100 000 2.625% Virgin Money UK PLC 19/08/2031                           | 103 046           | 0,00              |
| 100 000 3.375% Vodafone Group PLC 08/08/2049                            | 85 724            | 0,00              |
| 100 000 5.125% Vodafone Group PLC 02/12/2052                            | 114 837           | 0,01              |
| 100 000 5.625% Walmart Inc 27/03/2034                                   | 137 069           | 0,01              |
| 100 000 4.625% Wellcome Trust Finance PLC 25/07/2036                    | 127 139           | 0,01              |
| 100 000 1.500% Wellcome Trust Ltd 14/07/2071                            | 52 628            | 0,00              |
| 200 000 2.000% Wells Fargo & Co 28/07/2025                              | 229 770           | 0,01              |
| 100 000 4.500% Welltower OP LLC 01/12/2034                              | 106 608           | 0,00              |
| 100 000 1.642% Westfield Stratford City Finance NO 2 PLC 04/08/2031     | 108 018           | 0,00              |
| 100 000 4.250% WHG Treasury PLC 06/10/2045                              | 110 599           | 0,00              |
| 100 000 3.375% Yorkshire Building Society 13/09/2028                    | 106 465           | 0,00              |
| 100 000 1.750% Yorkshire Water Finance PLC 26/11/2026                   | 109 652           | 0,00              |
| 100 000 3.625% Yorkshire Water Finance PLC 01/08/2029                   | 113 689           | 0,01              |
| 100 000 5.125% Zurich Finance Ireland Designated Activity Co 23/11/2052 | 111 851           | 0,01              |
|   | <b>25 660 214</b> | <b>0,97</b>       |
| <b>Couronne suédoise – 0,02 %</b>                                       |                   |                   |
| 500 000 1.000% Nordea Hypotek AB 18/09/2024                             | 46 386            | 0,00              |
| 2 000 000 1.000% Skandinaviska Enskilda Banken AB 18/12/2024            | 184 475           | 0,01              |
| 2 000 000 1.000% Stadshypotek AB 03/09/2025                             | 181 541           | 0,01              |
| 600 000 1.000% Swedbank Hypotek AB 18/09/2024                           | 55 665            | 0,00              |
|   | <b>468 067</b>    | <b>0,02</b>       |
| <b>Franco suisse – 0,12 %</b>   |                   |                   |
| 50 000 0.300% BMW International Investment BV 05/09/2024                | 53 332            | 0,00              |
| 100 000 0.000% Credit Suisse Schweiz AG 31/07/2025                      | 102 650           | 0,01              |
| 100 000 0.350% Luzerner Kantonalbank AG 05/02/2027                      | 102 528           | 0,01              |

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                  |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>            |                  |                   |
| <b>Franco suisse – 0,12 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 0.125% Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 26/04/2024    | 107 346          | 0,01              |
| 100 000 0.000% Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 29/07/2024    | 106 604          | 0,01              |
| 100 000 0.250% Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 16/11/2026    | 102 938          | 0,01              |
| 100 000 0.375% Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 12/05/2027    | 102 626          | 0,01              |
| 50 000 0.250% Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 12/10/2027     | 50 691           | 0,00              |
| 100 000 0.000% Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 25/02/2028    | 99 452           | 0,01              |
| 50 000 0.375% Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 21/03/2028     | 50 611           | 0,00              |
| 50 000 0.375% Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 10/07/2028     | 50 370           | 0,00              |
| 50 000 0.625% Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 09/10/2028     | 50 878           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 08/05/2029    | 97 879           | 0,00              |
| 100 000 0.000% Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 26/02/2030    | 95 504           | 0,00              |
| 100 000 0.250% Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 15/04/2030    | 97 026           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 20/06/2031    | 94 019           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 14/11/2031    | 93 314           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 19/12/2031    | 93 178           | 0,00              |
| 100 000 0.250% Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 26/04/2034    | 90 406           | 0,00              |
| 50 000 0.750% Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG 28/11/2034     | 47 563           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 31/10/2024 | 106 268          | 0,01              |
| 100 000 0.250% Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 01/12/2025 | 104 705          | 0,01              |
| 100 000 0.000% Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 13/03/2028 | 99 369           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 19/05/2028 | 101 667          | 0,01              |
| 100 000 0.625% Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 08/03/2029 | 101 286          | 0,01              |
| 100 000 0.300% Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 09/04/2029 | 99 160           | 0,00              |



## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                  |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>            |                  |                   |
| <b>Franc suisse – 0,12 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 0.200% Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 10/09/2029 | 97 784           | 0,00              |
| 100 000 0.550% Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 29/01/2031 | 98 238           | 0,00              |
| 100 000 0.000% Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 25/07/2031 | 92 874           | 0,00              |
| 100 000 0.100% Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 03/10/2031 | 93 363           | 0,00              |
| 100 000 0.100% Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 03/12/2031 | 93 064           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 23/03/2032 | 92 917           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 23/04/2032 | 92 784           | 0,00              |
| 100 000 0.650% Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 15/02/2033 | 96 329           | 0,00              |
| 50 000 0.700% Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG 04/03/2039  | 44 830           | 0,00              |
| 100 000 0.750% Roche Kapitalmarkt AG 24/09/2030                                    | 99 677           | 0,01              |
|  | <b>3 203 230</b> | <b>0,12</b>       |
| <b>Dollar américain – 13,97 %</b>  |                  |                   |
| 50 000 2.000% 3M Co 14/02/2025   | 47 656           | 0,00              |
| 50 000 2.875% 3M Co 15/10/2027   | 46 839           | 0,00              |
| 100 000 3.375% 3M Co 01/03/2029  | 94 283           | 0,00              |
| 200 000 2.375% 3M Co 26/08/2029  | 176 764          | 0,01              |
| 50 000 3.050% 3M Co 15/04/2030   | 45 688           | 0,00              |
| 150 000 4.000% 3M Co 14/09/2048  | 127 512          | 0,01              |
| 50 000 3.250% 3M Co 26/08/2049   | 37 273           | 0,00              |
| 150 000 0.950% 7-Eleven Inc 10/02/2026   | 134 778          | 0,01              |
| 200 000 1.800% 7-Eleven Inc 10/02/2031   | 158 364          | 0,01              |
| 150 000 2.800% 7-Eleven Inc 10/02/2051   | 97 152           | 0,00              |
| 100 000 3.750% Abbott Laboratories 30/11/2026                                      | 99 223           | 0,01              |
| 50 000 1.150% Abbott Laboratories 30/01/2028                                       | 43 670           | 0,00              |
| 50 000 1.400% Abbott Laboratories 30/06/2030                                       | 41 738           | 0,00              |
| 50 000 4.750% Abbott Laboratories 30/11/2036                                       | 51 903           | 0,00              |
| 50 000 6.000% Abbott Laboratories 01/04/2039                                       | 56 845           | 0,00              |
| 50 000 5.300% Abbott Laboratories 27/05/2040                                       | 53 708           | 0,00              |
| 50 000 4.900% Abbott Laboratories 30/11/2046                                       | 51 404           | 0,00              |
| 300 000 3.600% AbbVie Inc 14/05/2025   | 294 291          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                   |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>             |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 50 000 3.200% AbbVie Inc 14/05/2026   | 48 270           | 0,00              |
| 350 000 2.950% AbbVie Inc 21/11/2026  | 333 056          | 0,01              |
| 100 000 4.550% AbbVie Inc 15/03/2035  | 97 809           | 0,00              |
| 150 000 4.500% AbbVie Inc 14/05/2035  | 145 425          | 0,01              |
| 200 000 4.300% AbbVie Inc 14/05/2036  | 188 030          | 0,01              |
| 150 000 4.050% AbbVie Inc 21/11/2039  | 133 870          | 0,01              |
| 250 000 4.400% AbbVie Inc 06/11/2042  | 227 780          | 0,01              |
| 50 000 4.750% AbbVie Inc 15/03/2045   | 47 268           | 0,00              |
| 50 000 4.450% AbbVie Inc 14/05/2046   | 45 256           | 0,00              |
| 150 000 4.875% AbbVie Inc 14/11/2048  | 144 076          | 0,01              |
| 250 000 4.250% AbbVie Inc 21/11/2049  | 220 557          | 0,01              |
| 200 000 4.750% ABN AMRO Bank NV 28/07/2025  | 194 068          | 0,01              |
| 200 000 1.542% ABN AMRO Bank NV 16/06/2027  | 174 962          | 0,01              |
| 200 000 2.000% Abu Dhabi National Energy Co PJSC 29/04/2028                         | 177 796          | 0,01              |
| 50 000 3.400% Activision Blizzard Inc 15/09/2026                                    | 48 410           | 0,00              |
| 100 000 1.350% Activision Blizzard Inc 15/09/2030                                   | 81 013           | 0,00              |
| 50 000 2.500% Activision Blizzard Inc 15/09/2050                                    | 33 422           | 0,00              |
| 100 000 2.150% Acuity Brands Lighting Inc 15/12/2030                                | 81 475           | 0,00              |
| 200 000 3.949% Adani Electricity Mumbai Ltd 12/02/2030                              | 143 656          | 0,01              |
| 200 000 3.100% Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 02/02/2031                   | 129 206          | 0,01              |
| 50 000 2.300% Adobe Inc 01/02/2030  | 44 377           | 0,00              |
| 50 000 3.008% Advocate Health & Hospitals Corp 15/06/2050                           | 36 275           | 0,00              |
| 200 000 5.500% Aegon NV 11/04/2048  | 189 092          | 0,01              |
| 124 000 2.100% AEP Texas Inc 01/07/2030   | 102 856          | 0,01              |
| 50 000 4.150% AEP Texas Inc 01/05/2049  | 41 446           | 0,00              |
| 100 000 3.750% AEP Transmission Co LLC 01/12/2047                                   | 82 547           | 0,00              |
| 50 000 3.800% AEP Transmission Co LLC 15/06/2049                                    | 41 312           | 0,00              |
| 150 000 3.500% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 15/01/2025 | 143 779          | 0,01              |
| 200 000 6.500% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 15/07/2025 | 201 036          | 0,01              |
| 350 000 1.750% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 30/01/2026 | 312 588          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                   |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>           |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>             |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>     |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                                   |                  |                   |
| 200 000 3.000% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 29/10/2028 | 174 404          | 0,01              | 100 000 2.050% Air Products and Chemicals Inc 15/05/2030                    | 86 414           | 0,00              |
| 150 000 3.300% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 30/01/2032 | 123 882          | 0,01              | 100 000 2.700% Air Products and Chemicals Inc 15/05/2040                    | 76 412           | 0,00              |
| 150 000 3.400% AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 29/10/2033 | 121 201          | 0,01              | 50 000 2.800% Air Products and Chemicals Inc 15/05/2050                     | 35 933           | 0,00              |
| 200 000 5.125% Aeropuerto Internacional de Tocumen SA 11/08/2061                    | 154 596          | 0,01              | 150 000 4.125% Aircastle Ltd 01/05/2024                                     | 146 623          | 0,01              |
| 100 000 3.300% AES Corp 15/07/2025  | 94 683           | 0,00              | 200 000 2.000% Aker BP ASA 15/07/2026                                       | 180 272          | 0,01              |
| 150 000 1.375% AES Corp 15/01/2026  | 134 815          | 0,01              | 100 000 3.050% Alabama Power Co 15/03/2032                                  | 88 182           | 0,00              |
| 200 000 3.500% Aetna Inc 15/11/2024   | 195 420          | 0,01              | 100 000 4.150% Alabama Power Co 15/08/2044                                  | 85 565           | 0,00              |
| 100 000 4.125% Aetna Inc 15/11/2042   | 84 652           | 0,00              | 120 604 4.800% Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust 15/02/2029 | 116 669          | 0,01              |
| 100 000 3.875% Aetna Inc 15/08/2047   | 79 477           | 0,00              | 50 000 5.050% Albemarle Corp 01/06/2032                                     | 48 926           | 0,00              |
| 50 000 4.750% Aflac Inc 15/01/2049  | 46 647           | 0,00              | 50 000 5.650% Albemarle Corp 01/06/2052                                     | 47 807           | 0,00              |
| 180 000 3.375% African Development Bank 07/07/2025                                  | 177 385          | 0,01              | 200 000 6.125% Alcoa Nederland Holding BV 15/05/2028                        | 200 126          | 0,01              |
| 250 000 0.875% African Development Bank 22/07/2026                                  | 226 647          | 0,01              | 200 000 5.375% Alcon Finance Corp 06/12/2032                                | 206 036          | 0,01              |
| 200 000 4.375% African Development Bank 03/11/2027                                  | 204 860          | 0,01              | 200 000 4.900% Alexandria Real Estate Equities Inc 15/12/2030               | 195 120          | 0,01              |
| 50 000 2.750% Agilent Technologies Inc 15/09/2029                                   | 44 809           | 0,00              | 50 000 2.000% Alexandria Real Estate Equities Inc 18/05/2032                | 38 203           | 0,00              |
| 50 000 2.100% Agilent Technologies Inc 04/06/2030                                   | 41 792           | 0,00              | 100 000 1.875% Alexandria Real Estate Equities Inc 01/02/2033               | 74 899           | 0,00              |
| 50 000 4.800% Agree LP 01/10/2032   | 47 284           | 0,00              | 100 000 3.000% Alexandria Real Estate Equities Inc 18/05/2051               | 61 472           | 0,00              |
| 200 000 0.700% Agricultural Bank of China Ltd/ Hong Kong 17/06/2024                 | 190 706          | 0,01              | 100 000 3.550% Alexandria Real Estate Equities Inc 15/03/2052               | 69 867           | 0,00              |
| 200 000 2.250% Agricultural Bank of China Ltd/ Hong Kong 01/03/2027                 | 185 874          | 0,01              | 200 000 3.400% Alibaba Group Holding Ltd 06/12/2027                         | 188 516          | 0,01              |
| 50 000 5.024% AHS Hospital Corp 01/07/2045  | 49 341           | 0,00              | 200 000 4.400% Alibaba Group Holding Ltd 06/12/2057                         | 159 022          | 0,01              |
| 200 000 5.625% AIA Group Ltd 25/10/2027   | 208 280          | 0,01              | 200 000 3.250% Alibaba Group Holding Ltd 09/02/2061                         | 125 488          | 0,01              |
| 200 000 3.600% AIA Group Ltd 09/04/2029   | 188 578          | 0,01              | 100 000 3.439% Alimentation Couche-Tard Inc 13/05/2041                      | 74 512           | 0,00              |
| 50 000 3.200% AIA Group Ltd 16/09/2040  | 37 573           | 0,00              | 50 000 3.550% Allegion US Holding Co Inc 01/10/2027                         | 47 047           | 0,00              |
| 134 000 6.900% AIG SunAmerica Global Financing X 15/03/2032                         | 147 294          | 0,01              | 100 000 0.750% Allstate Corp 15/12/2025                                     | 89 644           | 0,00              |
| 129 325 3.600% Air Canada 2015-1 Class A Pass Through Trust 15/09/2028              | 121 232          | 0,01              | 150 000 1.450% Allstate Corp 15/12/2030                                     | 116 782          | 0,01              |
| 200 000 2.300% Air Lease Corp 01/02/2025  | 189 420          | 0,01              | 50 000 3.850% Allstate Corp 10/08/2049                                      | 40 155           | 0,00              |
| 50 000 3.375% Air Lease Corp 01/07/2025   | 47 537           | 0,00              | 50 000 3.875% Ally Financial Inc 21/05/2024                                 | 47 770           | 0,00              |
| 100 000 3.750% Air Lease Corp 01/06/2026  | 94 489           | 0,00              | 50 000 5.125% Ally Financial Inc 30/09/2024                                 | 48 194           | 0,00              |
| 50 000 1.875% Air Lease Corp 15/08/2026   | 44 386           | 0,00              | 50 000 4.625% Ally Financial Inc 30/03/2025                                 | 47 380           | 0,00              |
| 250 000 3.625% Air Lease Corp 01/04/2027  | 232 125          | 0,01              | 50 000 4.750% Ally Financial Inc 09/06/2027                                 | 46 317           | 0,00              |
| 300 000 2.500% Air Liquide Finance SA 27/09/2026                                    | 279 744          | 0,01              | 100 000 2.200% Ally Financial Inc 02/11/2028                                | 79 367           | 0,00              |
| 200 000 2.250% Air Liquide Finance SA 10/09/2029                                    | 172 668          | 0,01              | 50 000 8.000% Ally Financial Inc 01/11/2031                                 | 52 284           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 0.800% Alphabet Inc 15/08/2027                                      | 87 712           | 0,00              |
|   |                  |                   | 50 000 1.100% Alphabet Inc 15/08/2030                                       | 40 879           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 1.900% Alphabet Inc 15/08/2040                                  | 70 084           | 0,00              |
| 150 000 2.050% Alphabet Inc 15/08/2050                                  | 95 275           | 0,00              |
| 150 000 2.250% Alphabet Inc 15/08/2060                                  | 91 803           | 0,00              |
| 100 000 2.350% Altria Group Inc 06/05/2025                              | 94 976           | 0,00              |
| 50 000 4.400% Altria Group Inc 14/02/2026                               | 49 598           | 0,00              |
| 150 000 2.625% Altria Group Inc 16/09/2026                              | 140 449          | 0,01              |
| 50 000 2.450% Altria Group Inc 04/02/2032                               | 39 360           | 0,00              |
| 100 000 5.800% Altria Group Inc 14/02/2039                              | 97 813           | 0,00              |
| 150 000 3.400% Altria Group Inc 04/02/2041                              | 106 137          | 0,01              |
| 100 000 4.250% Altria Group Inc 09/08/2042                              | 78 134           | 0,00              |
| 100 000 4.500% Altria Group Inc 02/05/2043                              | 79 754           | 0,00              |
| 50 000 3.875% Altria Group Inc 16/09/2046                               | 35 945           | 0,00              |
| 50 000 4.450% Altria Group Inc 06/05/2050                               | 36 768           | 0,00              |
| 100 000 3.700% Altria Group Inc 04/02/2051                              | 67 387           | 0,00              |
| 100 000 4.000% Altria Group Inc 04/02/2061                              | 70 321           | 0,00              |
| 100 000 2.730% Amazon.com Inc 13/04/2024                                | 98 033           | 0,01              |
| 50 000 2.800% Amazon.com Inc 22/08/2024                                 | 48 921           | 0,00              |
| 100 000 4.700% Amazon.com Inc 29/11/2024                                | 100 697          | 0,01              |
| 50 000 3.800% Amazon.com Inc 05/12/2024                                 | 49 599           | 0,00              |
| 100 000 3.000% Amazon.com Inc 13/04/2025                                | 97 512           | 0,00              |
| 100 000 0.800% Amazon.com Inc 03/06/2025                                | 93 038           | 0,00              |
| 100 000 4.600% Amazon.com Inc 01/12/2025                                | 100 858          | 0,01              |
| 100 000 1.000% Amazon.com Inc 12/05/2026                                | 90 647           | 0,00              |
| 100 000 3.300% Amazon.com Inc 13/04/2027                                | 96 756           | 0,00              |
| 50 000 1.200% Amazon.com Inc 03/06/2027                                 | 44 370           | 0,00              |
| 50 000 3.150% Amazon.com Inc 22/08/2027                                 | 47 993           | 0,00              |
| 100 000 4.550% Amazon.com Inc 01/12/2027                                | 101 501          | 0,01              |
| 150 000 1.650% Amazon.com Inc 12/05/2028                                | 132 811          | 0,01              |
| 50 000 3.450% Amazon.com Inc 13/04/2029                                 | 48 132           | 0,00              |
| 300 000 1.500% Amazon.com Inc 03/06/2030                                | 249 570          | 0,01              |
| 100 000 3.600% Amazon.com Inc 13/04/2032                                | 94 827           | 0,00              |
| 200 000 4.700% Amazon.com Inc 01/12/2032                                | 205 060          | 0,01              |
| 50 000 3.875% Amazon.com Inc 22/08/2037                                 | 46 580           | 0,00              |
| 100 000 2.875% Amazon.com Inc 12/05/2041                                | 78 560           | 0,00              |
| 175 000 4.050% Amazon.com Inc 22/08/2047                                | 159 092          | 0,01              |
| 50 000 2.500% Amazon.com Inc 03/06/2050                                 | 33 846           | 0,00              |
| 200 000 3.100% Amazon.com Inc 12/05/2051                                | 151 618          | 0,01              |
| 150 000 3.950% Amazon.com Inc 13/04/2052                                | 133 107          | 0,01              |
| 150 000 4.250% Amazon.com Inc 22/08/2057                                | 136 921          | 0,01              |
| 100 000 2.700% Amazon.com Inc 03/06/2060                                | 65 640           | 0,00              |
| 150 000 3.250% Amazon.com Inc 12/05/2061                                | 110 358          | 0,01              |
| 50 000 4.100% Amazon.com Inc 13/04/2062                                 | 44 000           | 0,00              |
| 100 000 2.630% Amcor Flexibles North America Inc 19/06/2030             | 83 802           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>             |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 50 000 2.500% Ameren Corp 15/09/2024  | 48 000           | 0,00              |
| 100 000 4.500% Ameren Illinois Co 15/03/2049                                  | 93 205           | 0,00              |
| 50 000 3.250% Ameren Illinois Co 15/03/2050                                   | 37 307           | 0,00              |
| 200 000 3.625% America Movil SAB de CV 22/04/2029                             | 186 928          | 0,01              |
| 50 000 6.125% America Movil SAB de CV 30/03/2040                              | 54 074           | 0,00              |
| 75 645 3.350% American Airlines 2017-2 Class AA Pass Through Trust 15/04/2031 | 67 462           | 0,00              |
| 41 864 3.150% American Airlines 2019-1 Class AA Pass Through Trust 15/08/2033 | 36 400           | 0,00              |
| 150 000 3.375% American Assets Trust LP 01/02/2031                            | 120 006          | 0,01              |
| 100 000 4.300% American Electric Power Co Inc 01/12/2028                      | 97 667           | 0,00              |
| 50 000 2.300% American Electric Power Co Inc 01/03/2030                       | 42 179           | 0,00              |
| 50 000 3.000% American Express Co 30/10/2024                                  | 48 764           | 0,00              |
| 100 000 2.250% American Express Co 04/03/2025                                 | 95 446           | 0,00              |
| 100 000 3.125% American Express Co 20/05/2026                                 | 95 354           | 0,00              |
| 200 000 2.550% American Express Co 04/03/2027                                 | 185 116          | 0,01              |
| 100 000 5.850% American Express Co 05/11/2027                                 | 105 017          | 0,01              |
| 200 000 4.050% American Express Co 03/05/2029                                 | 195 088          | 0,01              |
| 100 000 4.420% American Express Co 03/08/2033                                 | 95 876           | 0,00              |
| 50 000 4.050% American Express Co 03/12/2042                                  | 46 143           | 0,00              |
| 50 000 4.500% American Financial Group Inc/ OH 15/06/2047                     | 41 933           | 0,00              |
| 50 000 4.900% American Homes 4 Rent LP 15/02/2029                             | 48 151           | 0,00              |
| 200 000 3.625% American Homes 4 Rent LP 15/04/2032                            | 173 366          | 0,01              |
| 50 000 0.550% American Honda Finance Corp 12/07/2024                          | 47 406           | 0,00              |
| 100 000 1.500% American Honda Finance Corp 13/01/2025                         | 94 677           | 0,00              |
| 50 000 1.000% American Honda Finance Corp 10/09/2025                          | 45 895           | 0,00              |
| 100 000 3.500% American Honda Finance Corp 15/02/2028                         | 95 878           | 0,00              |
| 200 000 2.500% American International Group Inc 30/06/2025                    | 189 346          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                     |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>               |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 4.800% American International Group Inc 10/07/2045              | 90 616           | 0,00              | 50 000 3.000% Amgen Inc 22/02/2029  | 45 964           | 0,00              |
| 50 000 4.750% American International Group Inc 01/04/2048               | 44 903           | 0,00              | 100 000 4.050% Amgen Inc 18/08/2029   | 96 616           | 0,00              |
| 100 000 4.375% American International Group Inc 30/06/2050              | 85 512           | 0,00              | 50 000 5.250% Amgen Inc 02/03/2030  | 51 086           | 0,00              |
| 100 000 3.375% American Tower Corp 15/10/2026                           | 94 751           | 0,00              | 150 000 2.300% Amgen Inc 25/02/2031   | 126 232          | 0,01              |
| 150 000 2.750% American Tower Corp 15/01/2027                           | 138 298          | 0,01              | 100 000 2.000% Amgen Inc 15/01/2032   | 81 460           | 0,00              |
| 50 000 3.650% American Tower Corp 15/03/2027                            | 47 463           | 0,00              | 100 000 3.350% Amgen Inc 22/02/2032   | 90 148           | 0,00              |
| 50 000 3.550% American Tower Corp 15/07/2027                            | 47 132           | 0,00              | 50 000 5.250% Amgen Inc 02/03/2033  | 51 351           | 0,00              |
| 50 000 2.100% American Tower Corp 15/06/2030                            | 40 743           | 0,00              | 50 000 6.375% Amgen Inc 01/06/2037  | 55 555           | 0,00              |
| 100 000 2.700% American Tower Corp 15/04/2031                           | 83 682           | 0,00              | 100 000 3.150% Amgen Inc 21/02/2040   | 78 432           | 0,00              |
| 50 000 2.300% American Tower Corp 15/09/2031                            | 40 087           | 0,00              | 100 000 4.950% Amgen Inc 01/10/2041   | 95 351           | 0,00              |
| 50 000 3.700% American Tower Corp 15/10/2049                            | 36 257           | 0,00              | 150 000 4.563% Amgen Inc 15/06/2048   | 135 934          | 0,01              |
| 100 000 3.100% American Tower Corp 15/06/2050                           | 65 631           | 0,00              | 100 000 3.375% Amgen Inc 21/02/2050   | 74 883           | 0,00              |
| 100 000 2.650% American Transmission Systems Inc 15/01/2032             | 84 177           | 0,00              | 100 000 4.663% Amgen Inc 15/06/2051   | 90 986           | 0,00              |
| 50 000 3.750% American Water Capital Corp 01/09/2028                    | 47 872           | 0,00              | 50 000 3.000% Amgen Inc 15/01/2052  | 34 326           | 0,00              |
| 50 000 2.800% American Water Capital Corp 01/05/2030                    | 44 518           | 0,00              | 100 000 4.200% Amgen Inc 22/02/2052   | 84 923           | 0,00              |
| 50 000 4.300% American Water Capital Corp 01/12/2042                    | 44 584           | 0,00              | 150 000 4.875% Amgen Inc 01/03/2053   | 140 530          | 0,01              |
| 50 000 3.750% American Water Capital Corp 01/09/2047                    | 40 286           | 0,00              | 550 000 5.650% Amgen Inc 02/03/2053   | 572 407          | 0,02              |
| 50 000 4.200% American Water Capital Corp 01/09/2048                    | 42 772           | 0,00              | 100 000 2.770% Amgen Inc 01/09/2053   | 63 932           | 0,00              |
| 50 000 4.150% American Water Capital Corp 01/06/2049                    | 42 753           | 0,00              | 50 000 5.750% Amgen Inc 02/03/2063  | 51 873           | 0,00              |
| 50 000 3.250% American Water Capital Corp 01/06/2051                    | 36 662           | 0,00              | 150 000 2.200% Amphenol Corp 15/09/2031   | 124 537          | 0,01              |
| 50 000 3.450% Amerigo Life Inc 15/04/2031                               | 38 963           | 0,00              | 50 000 2.100% Analog Devices Inc 01/10/2031   | 42 094           | 0,00              |
| 200 000 3.400% AmerisourceBergen Corp 15/05/2024                        | 196 208          | 0,01              | 100 000 2.950% Analog Devices Inc 01/10/2051  | 73 271           | 0,00              |
| 100 000 2.805% AmFam Holdings Inc 11/03/2031                            | 76 624           | 0,00              | 200 000 4.750% Anglo American Capital PLC 16/03/2052                                  | 169 970          | 0,01              |
| 100 000 3.833% AmFam Holdings Inc 11/03/2051                            | 67 595           | 0,00              | 100 000 3.650% Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 01/02/2026 | 98 137           | 0,01              |
| 200 000 3.125% Amgen Inc 01/05/2025                                     | 194 142          | 0,01              | 100 000 4.700% Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 01/02/2036 | 99 325           | 0,01              |
| 50 000 2.600% Amgen Inc 19/08/2026                                      | 47 069           | 0,00              | 100 000 4.700% Anheuser-Busch InBev Finance Inc 01/02/2036                            | 98 945           | 0,01              |
| 100 000 1.650% Amgen Inc 15/08/2028                                     | 86 840           | 0,00              | 50 000 4.900% Anheuser-Busch InBev Finance Inc 01/02/2046                             | 48 850           | 0,00              |
|   |                  |                   | 150 000 4.000% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 13/04/2028                          | 147 858          | 0,01              |
|   |                  |                   | 200 000 4.750% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 23/01/2029                          | 204 296          | 0,01              |
|   |                  |                   | 100 000 3.500% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 01/06/2030                          | 94 327           | 0,00              |
|   |                  |                   | 150 000 4.900% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 23/01/2031                          | 155 232          | 0,01              |
|   |                  |                   | 100 000 4.375% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 15/04/2038                          | 94 857           | 0,00              |
|   |                  |                   | 50 000 8.200% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 15/01/2039                           | 65 291           | 0,00              |
|   |                  |                   | 150 000 5.450% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 23/01/2039                          | 157 480          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 8.000% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 15/11/2039             | 64 307           | 0,00              | 50 000 1.250% Apple Inc 20/08/2030                                      | 40 951           | 0,00              |
| 150 000 4.350% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 01/06/2040            | 139 611          | 0,01              | 200 000 1.650% Apple Inc 08/02/2031                                     | 167 158          | 0,01              |
| 159 000 4.600% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 15/04/2048            | 150 610          | 0,01              | 100 000 3.350% Apple Inc 08/08/2032                                     | 94 414           | 0,00              |
| 75 000 5.550% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 23/01/2049             | 80 983           | 0,00              | 200 000 4.500% Apple Inc 23/02/2036                                     | 206 662          | 0,01              |
| 250 000 5.800% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 23/01/2059            | 274 472          | 0,01              | 100 000 2.375% Apple Inc 08/02/2041                                     | 74 929           | 0,00              |
| 50 000 2.750% Antares Holdings LP 15/01/2027                            | 40 738           | 0,00              | 50 000 3.850% Apple Inc 04/05/2043                                      | 45 546           | 0,00              |
| 200 000 1.250% ANZ New Zealand Int'l Ltd/ London 22/06/2026             | 178 354          | 0,01              | 50 000 4.375% Apple Inc 13/05/2045                                      | 48 512           | 0,00              |
| 100 000 3.750% Aon Corp 02/05/2029                                      | 95 527           | 0,00              | 50 000 4.650% Apple Inc 23/02/2046                                      | 50 163           | 0,00              |
| 200 000 2.800% Aon Corp 15/05/2030                                      | 176 856          | 0,01              | 150 000 3.750% Apple Inc 12/09/2047                                     | 131 083          | 0,01              |
| 50 000 2.850% Aon Corp / Aon Global Holdings PLC 28/05/2027             | 46 533           | 0,00              | 100 000 2.950% Apple Inc 11/09/2049                                     | 75 573           | 0,00              |
| 100 000 3.900% Aon Corp / Aon Global Holdings PLC 28/02/2052            | 80 731           | 0,00              | 100 000 2.650% Apple Inc 11/05/2050                                     | 70 684           | 0,00              |
| 50 000 3.875% AP Moller - Maersk A/S 28/09/2025                         | 48 930           | 0,00              | 100 000 2.650% Apple Inc 08/02/2051                                     | 70 126           | 0,00              |
| 50 000 4.500% AP Moller - Maersk A/S 20/06/2029                         | 49 604           | 0,00              | 100 000 2.700% Apple Inc 05/08/2051                                     | 70 423           | 0,00              |
| 100 000 4.200% APA Infrastructure Ltd 23/03/2025                        | 97 886           | 0,00              | 100 000 3.950% Apple Inc 08/08/2052                                     | 89 637           | 0,00              |
| 100 000 4.400% Apollo Management Holdings LP 27/05/2026                 | 95 957           | 0,00              | 100 000 2.800% Apple Inc 08/02/2061                                     | 68 115           | 0,00              |
| 50 000 4.872% Apollo Management Holdings LP 15/02/2029                  | 47 762           | 0,00              | 100 000 2.850% Apple Inc 05/08/2061                                     | 68 958           | 0,00              |
| 50 000 5.000% Apollo Management Holdings LP 15/03/2048                  | 45 267           | 0,00              | 100 000 4.100% Apple Inc 08/08/2062                                     | 89 232           | 0,00              |
| 50 000 3.400% Appalachian Power Co 01/06/2025                           | 48 435           | 0,00              | 50 000 3.300% Applied Materials Inc 01/04/2027                          | 48 303           | 0,00              |
| 150 000 3.700% Appalachian Power Co 01/05/2050                          | 115 240          | 0,01              | 50 000 1.750% Applied Materials Inc 01/06/2030                          | 41 999           | 0,00              |
| 250 000 2.750% Apple Inc 13/01/2025                                     | 243 607          | 0,01              | 100 000 5.850% Applied Materials Inc 15/06/2041                         | 110 824          | 0,01              |
| 200 000 2.500% Apple Inc 09/02/2025                                     | 194 030          | 0,01              | 50 000 2.750% Applied Materials Inc 01/06/2050                          | 35 791           | 0,00              |
| 100 000 3.200% Apple Inc 13/05/2025                                     | 98 109           | 0,01              | 50 000 3.600% AptarGroup Inc 15/03/2032                                 | 44 087           | 0,00              |
| 200 000 0.550% Apple Inc 20/08/2025                                     | 184 332          | 0,01              | 100 000 3.100% Aptiv PLC 01/12/2051                                     | 63 409           | 0,00              |
| 100 000 0.700% Apple Inc 08/02/2026                                     | 90 979           | 0,00              | 100 000 4.150% Aptiv PLC / Aptiv Corp 01/05/2052                        | 78 159           | 0,00              |
| 100 000 2.050% Apple Inc 11/09/2026                                     | 93 491           | 0,00              | 200 000 1.260% Arab Petroleum Investments Corp 10/02/2026               | 182 406          | 0,01              |
| 100 000 3.350% Apple Inc 09/02/2027                                     | 97 618           | 0,00              | 50 000 4.250% ArcelorMittal SA 16/07/2029                               | 47 427           | 0,00              |
| 150 000 3.200% Apple Inc 11/05/2027                                     | 146 170          | 0,01              | 200 000 6.800% ArcelorMittal SA 29/11/2032                              | 209 916          | 0,01              |
| 100 000 3.000% Apple Inc 20/06/2027                                     | 96 592           | 0,00              | 100 000 7.000% ArcelorMittal SA 15/10/2039                              | 105 305          | 0,01              |
| 200 000 1.200% Apple Inc 08/02/2028                                     | 175 848          | 0,01              | 50 000 4.011% Arch Capital Finance LLC 15/12/2026                       | 48 520           | 0,00              |
| 150 000 1.400% Apple Inc 05/08/2028                                     | 131 460          | 0,01              | 225 000 2.500% Archer-Daniels-Midland Co 11/08/2026                     | 212 269          | 0,01              |
| 100 000 2.200% Apple Inc 11/09/2029                                     | 89 484           | 0,00              | 50 000 4.500% Archer-Daniels-Midland Co 15/03/2049                      | 47 427           | 0,00              |
| 100 000 1.650% Apple Inc 11/05/2030                                     | 85 096           | 0,00              | 50 000 3.250% Ares Capital Corp 15/07/2025                              | 45 840           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 3.875% Ares Capital Corp 15/01/2026                             | 92 207           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 2.150% Ares Capital Corp 15/07/2026                             | 85 729           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 2.875% Ares Capital Corp 15/06/2028                             | 82 560           | 0,00              |
|   |                  |                   | 50 000 3.150% Arizona Public Service Co 15/05/2025                      | 48 027           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 200 000 5.375% Aroundtown SA 21/03/2029                                 | 147 644          | 0,01              |
| 132 000 3.250% Arrow Electronics Inc 08/09/2024                         | 128 317          | 0,01              |
| 100 000 2.400% Arthur J Gallagher & Co 09/11/2031                       | 80 902           | 0,00              |
| 100 000 3.500% Arthur J Gallagher & Co 20/05/2051                       | 72 080           | 0,00              |
| 50 000 3.945% Ascension Health 15/11/2046                               | 43 333           | 0,00              |
| 100 000 4.847% Ascension Health 15/11/2053                              | 99 143           | 0,01              |
| 200 000 1.500% Ashtead Capital Inc 12/08/2026                           | 175 128          | 0,01              |
| 200 000 2.450% Ashtead Capital Inc 12/08/2031                           | 157 442          | 0,01              |
| 73 000 0.625% Asian Development Bank 08/10/2024                         | 69 048           | 0,00              |
| 100 000 1.500% Asian Development Bank 18/10/2024                        | 95 801           | 0,00              |
| 100 000 2.000% Asian Development Bank 22/01/2025                        | 96 228           | 0,00              |
| 250 000 0.625% Asian Development Bank 29/04/2025                        | 232 842          | 0,01              |
| 200 000 2.875% Asian Development Bank 06/05/2025                        | 195 052          | 0,01              |
| 150 000 0.375% Asian Development Bank 03/09/2025                        | 137 602          | 0,01              |
| 250 000 0.500% Asian Development Bank 04/02/2026                        | 227 280          | 0,01              |
| 250 000 1.000% Asian Development Bank 14/04/2026                        | 229 545          | 0,01              |
| 350 000 1.500% Asian Development Bank 20/01/2027                        | 321 898          | 0,01              |
| 250 000 3.125% Asian Development Bank 20/08/2027                        | 243 480          | 0,01              |
| 100 000 2.500% Asian Development Bank 02/11/2027                        | 94 716           | 0,00              |
| 100 000 5.820% Asian Development Bank 16/06/2028                        | 109 029          | 0,01              |
| 200 000 1.750% Asian Development Bank 19/09/2029                        | 177 522          | 0,01              |
| 350 000 1.875% Asian Development Bank 24/01/2030                        | 311 454          | 0,01              |
| 250 000 0.750% Asian Development Bank 08/10/2030                        | 202 255          | 0,01              |
| 100 000 1.500% Asian Development Bank 04/03/2031                        | 85 371           | 0,00              |
| 100 000 3.125% Asian Development Bank 27/04/2032                        | 95 732           | 0,00              |
| 100 000 3.875% Asian Development Bank 28/09/2032                        | 101 463          | 0,01              |
| 100 000 2.250% Asian Infrastructure Investment Bank 16/05/2024          | 97 453           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 0.500% Asian Infrastructure Investment Bank 30/10/2024          | 94 083           | 0,00              |
| 150 000 0.500% Asian Infrastructure Investment Bank 28/05/2025          | 138 693          | 0,01              |
| 200 000 0.500% Asian Infrastructure Investment Bank 27/01/2026          | 180 940          | 0,01              |
| 200 000 3.750% Asian Infrastructure Investment Bank 14/09/2027          | 198 588          | 0,01              |
| 100 000 2.650% Assurant Inc 15/01/2032                                  | 75 844           | 0,00              |
| 50 000 1.200% Astrazeneca Finance LLC 28/05/2026                        | 45 540           | 0,00              |
| 50 000 2.250% Astrazeneca Finance LLC 28/05/2031                        | 42 966           | 0,00              |
| 200 000 3.375% AstraZeneca PLC 16/11/2025                               | 196 072          | 0,01              |
| 100 000 0.700% AstraZeneca PLC 08/04/2026                               | 90 010           | 0,00              |
| 50 000 4.000% AstraZeneca PLC 17/01/2029                                | 49 271           | 0,00              |
| 50 000 1.375% AstraZeneca PLC 06/08/2030                                | 40 774           | 0,00              |
| 50 000 6.450% AstraZeneca PLC 15/09/2037                                | 58 965           | 0,00              |
| 150 000 4.000% AstraZeneca PLC 18/09/2042                               | 136 441          | 0,01              |
| 50 000 2.125% AstraZeneca PLC 06/08/2050                                | 31 619           | 0,00              |
| 100 000 3.875% AT&T Inc 15/01/2026                                      | 98 265           | 0,01              |
| 200 000 1.700% AT&T Inc 25/03/2026                                      | 183 566          | 0,01              |
| 250 000 1.650% AT&T Inc 01/02/2028                                      | 219 532          | 0,01              |
| 200 000 4.300% AT&T Inc 15/02/2030                                      | 194 474          | 0,01              |
| 50 000 2.750% AT&T Inc 01/06/2031                                       | 43 041           | 0,00              |
| 150 000 2.250% AT&T Inc 01/02/2032                                      | 122 499          | 0,01              |
| 150 000 2.550% AT&T Inc 01/12/2033                                      | 120 661          | 0,01              |
| 100 000 4.500% AT&T Inc 15/05/2035                                      | 93 776           | 0,00              |
| 100 000 5.250% AT&T Inc 01/03/2037                                      | 99 841           | 0,01              |
| 50 000 4.900% AT&T Inc 15/08/2037                                       | 47 693           | 0,00              |
| 100 000 4.850% AT&T Inc 01/03/2039                                      | 93 797           | 0,00              |
| 150 000 3.500% AT&T Inc 01/06/2041                                      | 118 398          | 0,01              |
| 50 000 4.300% AT&T Inc 15/12/2042                                       | 43 544           | 0,00              |
| 200 000 3.100% AT&T Inc 01/02/2043                                      | 147 680          | 0,01              |
| 150 000 4.350% AT&T Inc 15/06/2045                                      | 127 950          | 0,01              |
| 150 000 4.500% AT&T Inc 09/03/2048                                      | 129 253          | 0,01              |
| 50 000 4.550% AT&T Inc 09/03/2049                                       | 43 473           | 0,00              |
| 100 000 3.650% AT&T Inc 01/06/2051                                      | 75 691           | 0,00              |
| 200 000 3.500% AT&T Inc 15/09/2053                                      | 145 234          | 0,01              |
| 250 000 3.550% AT&T Inc 15/09/2055                                      | 179 582          | 0,01              |
| 250 000 3.800% AT&T Inc 01/12/2057                                      | 185 700          | 0,01              |
| 300 000 3.650% AT&T Inc 15/09/2059                                      | 214 353          | 0,01              |
| 100 000 3.850% AT&T Inc 01/06/2060                                      | 74 945           | 0,00              |
| 200 000 2.500% Athene Global Funding 24/03/2028                         | 168 382          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>               |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>         |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                                       |                  |                   |
| 200 000 1.985% Athene Global Funding 19/08/2028                                 | 162 200          | 0,01              |
| 100 000 2.550% Athene Global Funding 19/11/2030                                 | 78 431           | 0,00              |
| 50 000 3.450% Athene Holding Ltd 15/05/2052                                     | 31 603           | 0,00              |
| 200 000 1.500% Atmos Energy Corp 15/01/2031                                     | 160 274          | 0,01              |
| 100 000 4.125% Atmos Energy Corp 15/10/2044                                     | 86 948           | 0,00              |
| 150 000 4.300% Atmos Energy Corp 01/10/2048                                     | 133 087          | 0,01              |
| 200 000 2.950% Australia & New Zealand Banking Group Ltd 22/07/2030             | 184 878          | 0,01              |
| 200 000 6.742% Australia & New Zealand Banking Group Ltd 08/12/2032             | 211 564          | 0,01              |
| 275 000 2.570% Australia & New Zealand Banking Group Ltd 25/11/2035             | 212 710          | 0,01              |
| 250 000 5.088% Australia & New Zealand Banking Group Ltd/New York NY 08/12/2025 | 252 177          | 0,01              |
| 150 000 2.400% Autodesk Inc 15/12/2031  | 124 788          | 0,01              |
| 100 000 1.700% Automatic Data Processing Inc 15/05/2028                         | 89 298           | 0,00              |
| 50 000 1.250% Automatic Data Processing Inc 01/09/2030                          | 40 987           | 0,00              |
| 50 000 2.400% AutoNation Inc 01/08/2031   | 38 405           | 0,00              |
| 100 000 3.750% AutoZone Inc 01/06/2027  | 96 784           | 0,00              |
| 50 000 1.650% AutoZone Inc 15/01/2031   | 39 784           | 0,00              |
| 50 000 3.300% AvalonBay Communities Inc 01/06/2029                              | 45 318           | 0,00              |
| 50 000 2.050% AvalonBay Communities Inc 15/01/2032                              | 40 200           | 0,00              |
| 50 000 4.350% AvalonBay Communities Inc 15/04/2048                              | 42 561           | 0,00              |
| 50 000 4.875% Avery Dennison Corp 06/12/2028                                    | 49 706           | 0,00              |
| 50 000 4.875% Aviation Capital Group LLC 01/10/2025                             | 48 212           | 0,00              |
| 50 000 1.950% Aviation Capital Group LLC 30/01/2026                             | 44 447           | 0,00              |
| 200 000 1.950% Aviation Capital Group LLC 20/09/2026                            | 173 102          | 0,01              |
| 50 000 4.625% Avnet Inc 15/04/2026  | 49 261           | 0,00              |
| 200 000 5.250% Avolon Holdings Funding Ltd 15/05/2024                           | 197 950          | 0,01              |
| 50 000 3.950% Avolon Holdings Funding Ltd 01/07/2024                            | 48 622           | 0,00              |
| 50 000 4.250% Avolon Holdings Funding Ltd 15/04/2026                            | 46 833           | 0,00              |
| 50 000 4.375% Avolon Holdings Funding Ltd 01/05/2026                            | 46 915           | 0,00              |
| 50 000 3.250% Avolon Holdings Funding Ltd 15/02/2027                            | 44 539           | 0,00              |

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>                                    |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 50 000 2.528% Avolon Holdings Funding Ltd 18/11/2027   | 42 211           | 0,00              |
| 200 000 3.400% BAE Systems PLC 15/04/2030  | 183 714          | 0,01              |
| 100 000 5.800% BAE Systems PLC 11/10/2041  | 105 007          | 0,01              |
| 200 000 2.375% Baidu Inc 23/08/2031  | 164 698          | 0,01              |
| 100 000 5.125% Baker Hughes Holdings LLC 15/09/2040  | 96 995           | 0,00              |
| 100 000 2.061% Baker Hughes Holdings LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc 15/12/2026                          | 90 670           | 0,00              |
| 50 000 3.337% Baker Hughes Holdings LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc 15/12/2027                           | 46 856           | 0,00              |
| 50 000 3.138% Baker Hughes Holdings LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc 07/11/2029                           | 44 886           | 0,00              |
| 100 000 2.250% Baltimore Gas and Electric Co 15/06/2031  | 84 219           | 0,00              |
| 50 000 3.500% Baltimore Gas and Electric Co 15/08/2046   | 38 571           | 0,00              |
| 150 000 2.900% Baltimore Gas and Electric Co 15/06/2050  | 103 432          | 0,01              |
| 200 000 5.862% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 14/09/2026   | 197 586          | 0,01              |
| 150 000 5.375% Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand 17/04/2025 | 149 299          | 0,01              |
| 200 000 3.496% Banco Santander SA 24/03/2025   | 192 154          | 0,01              |
| 200 000 5.147% Banco Santander SA 18/08/2025   | 196 676          | 0,01              |
| 200 000 1.849% Banco Santander SA 25/03/2026   | 179 126          | 0,01              |
| 200 000 4.250% Banco Santander SA 11/04/2027   | 188 782          | 0,01              |
| 200 000 1.722% Banco Santander SA 14/09/2027   | 174 198          | 0,01              |
| 200 000 3.490% Banco Santander SA 28/05/2030   | 175 258          | 0,01              |
| 200 000 2.958% Banco Santander SA 25/03/2031   | 164 256          | 0,01              |
| 500 000 3.688% BANK 2018-BNK10 15/02/2061  | 464 474          | 0,02              |
| 175 000 3.898% BANK 2018-BNK10 15/02/2061  | 157 887          | 0,01              |
| 50 000 4.255% BANK 2018-BNK12 15/05/2061   | 47 739           | 0,00              |
| 300 000 4.217% BANK 2018-BNK13 15/08/2061  | 286 126          | 0,01              |
| 50 000 4.200% Bank of America Corp 26/08/2024  | 49 199           | 0,00              |
| 100 000 4.000% Bank of America Corp 22/01/2025   | 97 918           | 0,00              |
| 200 000 3.950% Bank of America Corp 21/04/2025   | 193 816          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 0.976% Bank of America Corp<br>22/04/2025                       | 95 275           | 0,00              |
| 200 000 3.841% Bank of America Corp<br>25/04/2025                       | 196 286          | 0,01              |
| 100 000 3.875% Bank of America Corp<br>01/08/2025                       | 97 765           | 0,00              |
| 200 000 0.981% Bank of America Corp<br>25/09/2025                       | 186 786          | 0,01              |
| 50 000 3.093% Bank of America Corp<br>01/10/2025                        | 48 147           | 0,00              |
| 200 000 2.456% Bank of America Corp<br>22/10/2025                       | 190 522          | 0,01              |
| 200 000 1.530% Bank of America Corp<br>06/12/2025                       | 187 386          | 0,01              |
| 100 000 3.366% Bank of America Corp<br>23/01/2026                       | 96 187           | 0,00              |
| 200 000 2.015% Bank of America Corp<br>13/02/2026                       | 187 494          | 0,01              |
| 50 000 4.450% Bank of America Corp<br>03/03/2026                        | 48 960           | 0,00              |
| 100 000 3.384% Bank of America Corp<br>02/04/2026                       | 95 967           | 0,00              |
| 350 000 3.500% Bank of America Corp<br>19/04/2026                       | 336 479          | 0,01              |
| 200 000 1.319% Bank of America Corp<br>19/06/2026                       | 182 800          | 0,01              |
| 100 000 4.827% Bank of America Corp<br>22/07/2026                       | 98 803           | 0,01              |
| 50 000 1.197% Bank of America Corp<br>24/10/2026                        | 44 924           | 0,00              |
| 100 000 3.559% Bank of America Corp<br>23/04/2027                       | 95 310           | 0,00              |
| 200 000 1.734% Bank of America Corp<br>22/07/2027                       | 179 030          | 0,01              |
| 50 000 4.183% Bank of America Corp<br>25/11/2027                        | 48 360           | 0,00              |
| 150 000 3.824% Bank of America Corp<br>20/01/2028                       | 143 070          | 0,01              |
| 100 000 2.551% Bank of America Corp<br>04/02/2028                       | 91 025           | 0,00              |
| 250 000 3.705% Bank of America Corp<br>24/04/2028                       | 236 502          | 0,01              |
| 75 000 3.593% Bank of America Corp<br>21/07/2028                        | 70 510           | 0,00              |
| 200 000 4.948% Bank of America Corp<br>22/07/2028                       | 198 952          | 0,01              |
| 250 000 6.204% Bank of America Corp<br>10/11/2028                       | 261 347          | 0,01              |
| 300 000 3.419% Bank of America Corp<br>20/12/2028                       | 278 958          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 3.970% Bank of America Corp<br>05/03/2029                       | 94 713           | 0,00              |
| 200 000 4.271% Bank of America Corp<br>23/07/2029                       | 192 494          | 0,01              |
| 100 000 3.974% Bank of America Corp<br>07/02/2030                       | 93 641           | 0,00              |
| 150 000 3.194% Bank of America Corp<br>23/07/2030                       | 133 246          | 0,01              |
| 100 000 2.884% Bank of America Corp<br>22/10/2030                       | 86 966           | 0,00              |
| 150 000 1.898% Bank of America Corp<br>23/07/2031                       | 120 256          | 0,01              |
| 50 000 1.922% Bank of America Corp<br>24/10/2031                        | 39 925           | 0,00              |
| 100 000 2.651% Bank of America Corp<br>11/03/2032                       | 83 552           | 0,00              |
| 50 000 2.687% Bank of America Corp<br>22/04/2032                        | 41 751           | 0,00              |
| 150 000 2.299% Bank of America Corp<br>21/07/2032                       | 120 868          | 0,01              |
| 200 000 2.572% Bank of America Corp<br>20/10/2032                       | 163 484          | 0,01              |
| 100 000 2.972% Bank of America Corp<br>04/02/2033                       | 84 278           | 0,00              |
| 200 000 4.571% Bank of America Corp<br>27/04/2033                       | 190 264          | 0,01              |
| 100 000 5.015% Bank of America Corp<br>22/07/2033                       | 98 778           | 0,01              |
| 200 000 2.482% Bank of America Corp<br>21/09/2036                       | 151 508          | 0,01              |
| 100 000 3.846% Bank of America Corp<br>08/03/2037                       | 85 847           | 0,00              |
| 100 000 4.244% Bank of America Corp<br>24/04/2038                       | 89 975           | 0,00              |
| 130 000 7.750% Bank of America Corp<br>14/05/2038                       | 155 551          | 0,01              |
| 200 000 4.078% Bank of America Corp<br>23/04/2040                       | 173 548          | 0,01              |
| 100 000 2.676% Bank of America Corp<br>19/06/2041                       | 70 692           | 0,00              |
| 50 000 5.875% Bank of America Corp<br>07/02/2042                        | 53 665           | 0,00              |
| 50 000 5.000% Bank of America Corp<br>21/01/2044                        | 48 781           | 0,00              |
| 175 000 4.443% Bank of America Corp<br>20/01/2048                       | 154 962          | 0,01              |
| 150 000 3.946% Bank of America Corp<br>23/01/2049                       | 121 039          | 0,01              |
| 75 000 4.330% Bank of America Corp<br>15/03/2050                        | 64 669           | 0,00              |



## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                                |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>                          |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>  |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 4.083% Bank of America Corp<br>20/03/2051   | 40 897           | 0,00              | 50 000 4.289% Bank of New York Mellon Corp<br>13/06/2033                | 47 893           | 0,00              |
| 100 000 2.831% Bank of America Corp<br>24/10/2051  | 65 709           | 0,00              | 100 000 5.834% Bank of New York Mellon Corp<br>25/10/2033               | 106 814          | 0,01              |
| 100 000 3.483% Bank of America Corp<br>13/03/2052  | 75 091           | 0,00              | 50 000 0.700% Bank of Nova Scotia<br>15/04/2024                         | 47 785           | 0,00              |
| 100 000 2.972% Bank of America Corp<br>21/07/2052  | 67 407           | 0,00              | 50 000 0.650% Bank of Nova Scotia<br>31/07/2024                         | 47 157           | 0,00              |
| 49 478 3.311% Bank of America Merrill Lynch<br>Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3<br>15/02/2050 | 46 272           | 0,00              | 100 000 5.250% Bank of Nova Scotia<br>06/12/2024                        | 100 232          | 0,01              |
| 250 000 6.000% Bank of America NA<br>15/10/2036  | 269 330          | 0,01              | 100 000 1.450% Bank of Nova Scotia<br>10/01/2025                        | 93 787           | 0,00              |
| 300 000 5.000% Bank of China Ltd 13/11/2024  | 298 698          | 0,01              | 100 000 3.450% Bank of Nova Scotia<br>11/04/2025                        | 96 995           | 0,00              |
| 200 000 4.750% Bank of China Ltd/Paris<br>23/11/2025   | 200 640          | 0,01              | 50 000 1.050% Bank of Nova Scotia<br>02/03/2026                         | 44 786           | 0,00              |
| 250 000 4.000% Bank of East Asia Ltd<br>29/05/2030   | 228 477          | 0,01              | 50 000 1.350% Bank of Nova Scotia<br>24/06/2026                         | 44 599           | 0,00              |
| 200 000 6.253% Bank of Ireland Group PLC<br>16/09/2026   | 199 292          | 0,01              | 250 000 1.188% Bank of Nova Scotia<br>13/10/2026                        | 223 640          | 0,01              |
| 100 000 1.500% Bank of Montreal 10/01/2025   | 94 036           | 0,00              | 100 000 1.950% Bank of Nova Scotia<br>02/02/2027                        | 90 480           | 0,00              |
| 50 000 1.850% Bank of Montreal 01/05/2025  | 46 850           | 0,00              | 100 000 2.450% Bank of Nova Scotia<br>02/02/2032                        | 82 604           | 0,00              |
| 100 000 3.700% Bank of Montreal 07/06/2025   | 97 212           | 0,00              | 100 000 4.588% Bank of Nova Scotia<br>04/05/2037                        | 88 728           | 0,00              |
| 300 000 3.750% Bank of Montreal 25/07/2026   | 294 108          | 0,01              | 200 000 2.375% Banque Federative du Credit<br>Mutuel SA 21/11/2024      | 190 474          | 0,01              |
| 100 000 0.949% Bank of Montreal 22/01/2027   | 89 328           | 0,00              | 200 000 3.932% Barclays PLC 07/05/2025                                  | 194 618          | 0,01              |
| 100 000 2.650% Bank of Montreal 08/03/2027   | 92 426           | 0,00              | 200 000 5.200% Barclays PLC 12/05/2026                                  | 191 444          | 0,01              |
| 50 000 4.700% Bank of Montreal 14/09/2027  | 49 664           | 0,00              | 200 000 2.279% Barclays PLC 24/11/2027                                  | 175 822          | 0,01              |
| 50 000 5.203% Bank of Montreal 01/02/2028  | 50 422           | 0,00              | 200 000 5.501% Barclays PLC 09/08/2028                                  | 198 640          | 0,01              |
| 50 000 3.803% Bank of Montreal 15/12/2032  | 44 890           | 0,00              | 200 000 4.972% Barclays PLC 16/05/2029                                  | 192 910          | 0,01              |
| 100 000 3.088% Bank of Montreal 10/01/2037   | 79 867           | 0,00              | 200 000 2.645% Barclays PLC 24/06/2031                                  | 161 418          | 0,01              |
| 100 000 1.600% Bank of New York Mellon Corp<br>24/04/2025  | 93 289           | 0,00              | 200 000 7.437% Barclays PLC 02/11/2033                                  | 220 874          | 0,01              |
| 200 000 3.350% Bank of New York Mellon Corp<br>25/04/2025  | 193 518          | 0,01              | 50 000 5.700% Barrick North America<br>Finance LLC 30/05/2041           | 52 548           | 0,00              |
| 50 000 3.430% Bank of New York Mellon Corp<br>13/06/2025   | 48 938           | 0,00              | 100 000 5.950% Barrick PD Australia Finance<br>Pty Ltd 15/10/2039       | 107 317          | 0,01              |
| 100 000 4.414% Bank of New York Mellon Corp<br>24/07/2026  | 98 889           | 0,01              | 50 000 4.750% Basin Electric Power<br>Cooperative 26/04/2047            | 43 872           | 0,00              |
| 50 000 2.450% Bank of New York Mellon Corp<br>17/08/2026   | 46 110           | 0,00              | 100 000 3.222% BAT Capital Corp 15/08/2024                              | 97 084           | 0,00              |
| 100 000 2.050% Bank of New York Mellon Corp<br>26/01/2027  | 90 277           | 0,00              | 100 000 2.789% BAT Capital Corp 06/09/2024                              | 96 415           | 0,00              |
| 100 000 5.802% Bank of New York Mellon Corp<br>25/10/2028  | 103 865          | 0,01              | 50 000 4.700% BAT Capital Corp 02/04/2027                               | 49 069           | 0,00              |
| 250 000 3.300% Bank of New York Mellon Corp<br>23/08/2029  | 229 975          | 0,01              | 50 000 3.557% BAT Capital Corp 15/08/2027                               | 46 498           | 0,00              |
| 50 000 1.800% Bank of New York Mellon Corp<br>28/07/2031   | 39 448           | 0,00              | 50 000 2.259% BAT Capital Corp 25/03/2028                               | 42 943           | 0,00              |
|  |                  |                   | 50 000 4.906% BAT Capital Corp 02/04/2030                               | 48 233           | 0,00              |
|  |                  |                   | 100 000 4.390% BAT Capital Corp 15/08/2037                              | 81 623           | 0,00              |
|  |                  |                   | 150 000 3.734% BAT Capital Corp 25/09/2040                              | 107 286          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 4.540% BAT Capital Corp 15/08/2047                              | 74 326           | 0,00              | 600 000 3.963% Benchmark 2018-B8 Mortgage Trust 15/01/2052              | 566 689          | 0,02              |
| 150 000 4.758% BAT Capital Corp 06/09/2049                              | 114 544          | 0,01              | 50 000 4.232% Benchmark 2018-B8 Mortgage Trust 15/01/2052               | 47 301           | 0,00              |
| 50 000 3.984% BAT Capital Corp 25/09/2050                               | 34 053           | 0,00              | 100 000 3.250% Berkshire Hathaway Energy Co 15/04/2028                  | 95 587           | 0,00              |
| 50 000 5.650% BAT Capital Corp 16/03/2052                               | 43 833           | 0,00              | 100 000 1.650% Berkshire Hathaway Energy Co 15/05/2031                  | 80 292           | 0,00              |
| 50 000 1.668% BAT International Finance PLC 25/03/2026                  | 45 537           | 0,00              | 100 000 6.125% Berkshire Hathaway Energy Co 01/04/2036                  | 110 283          | 0,01              |
| 100 000 4.448% BAT International Finance PLC 16/03/2028                 | 95 085           | 0,00              | 100 000 4.500% Berkshire Hathaway Energy Co 01/02/2045                  | 89 477           | 0,00              |
| 100 000 1.322% Baxter International Inc 29/11/2024                      | 94 106           | 0,00              | 50 000 3.800% Berkshire Hathaway Energy Co 15/07/2048                   | 40 384           | 0,00              |
| 100 000 2.272% Baxter International Inc 01/12/2028                      | 86 864           | 0,00              | 50 000 4.250% Berkshire Hathaway Energy Co 15/10/2050                   | 43 133           | 0,00              |
| 50 000 1.730% Baxter International Inc 01/04/2031                       | 39 094           | 0,00              | 100 000 2.850% Berkshire Hathaway Energy Co 15/05/2051                  | 68 720           | 0,00              |
| 50 000 2.539% Baxter International Inc 01/02/2032                       | 40 735           | 0,00              | 50 000 1.850% Berkshire Hathaway Finance Corp 12/03/2030                | 42 947           | 0,00              |
| 50 000 3.500% Baxter International Inc 15/08/2046                       | 35 347           | 0,00              | 50 000 4.400% Berkshire Hathaway Finance Corp 15/05/2042                | 47 871           | 0,00              |
| 150 000 3.132% Baxter International Inc 01/12/2051                      | 97 198           | 0,00              | 100 000 4.300% Berkshire Hathaway Finance Corp 15/05/2043               | 92 328           | 0,00              |
| 50 000 3.375% Bayer US Finance II LLC 15/07/2024                        | 48 942           | 0,00              | 50 000 4.200% Berkshire Hathaway Finance Corp 15/08/2048                | 45 440           | 0,00              |
| 400 000 4.250% Bayer US Finance II LLC 15/12/2025                       | 391 624          | 0,02              | 100 000 4.250% Berkshire Hathaway Finance Corp 15/01/2049               | 92 250           | 0,00              |
| 200 000 4.625% Bayer US Finance II LLC 25/06/2038                       | 183 066          | 0,01              | 50 000 2.850% Berkshire Hathaway Finance Corp 15/10/2050                | 35 308           | 0,00              |
| 50 000 4.185% Baylor Scott & White Holdings 15/11/2045                  | 44 001           | 0,00              | 100 000 2.500% Berkshire Hathaway Finance Corp 15/01/2051               | 64 369           | 0,00              |
| 46 000 3.363% Becton Dickinson and Co 06/06/2024                        | 45 154           | 0,00              | 50 000 3.850% Berkshire Hathaway Finance Corp 15/03/2052                | 42 032           | 0,00              |
| 50 000 2.823% Becton Dickinson and Co 20/05/2030                        | 44 589           | 0,00              | 25 000 3.125% Berkshire Hathaway Inc 15/03/2026                         | 24 330           | 0,00              |
| 150 000 1.957% Becton Dickinson and Co 11/02/2031                       | 123 348          | 0,01              | 100 000 4.500% Berkshire Hathaway Inc 11/02/2043                        | 95 106           | 0,00              |
| 100 000 4.685% Becton Dickinson and Co 15/12/2044                       | 93 084           | 0,00              | 150 000 1.570% Berry Global Inc 15/01/2026                              | 136 275          | 0,01              |
| 50 000 4.669% Becton Dickinson and Co 06/06/2047                        | 46 629           | 0,00              | 150 000 4.875% Berry Global Inc 15/07/2026                              | 146 224          | 0,01              |
| 50 000 3.794% Becton Dickinson and Co 20/05/2050                        | 40 530           | 0,00              | 50 000 3.080% Beth Israel Lahey Health Inc 01/07/2051                   | 32 915           | 0,00              |
| 50 000 2.150% Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada 15/02/2032     | 40 946           | 0,00              | 200 000 4.375% Bharti Airtel Ltd 10/06/2025                             | 196 692          | 0,01              |
| 100 000 2.330% Belrose Funding Trust 15/08/2030                         | 77 089           | 0,00              | 50 000 4.125% BHP Billiton Finance USA Ltd 24/02/2042                   | 45 299           | 0,00              |
| 150 000 3.882% Benchmark 2018-B2 Mortgage Trust 15/02/2051              | 140 586          | 0,01              | 125 000 5.000% BHP Billiton Finance USA Ltd 30/09/2043                  | 126 425          | 0,01              |
| 50 000 4.025% Benchmark 2018-B3 Mortgage Trust 10/04/2051               | 47 159           | 0,00              | 50 000 2.250% Biogen Inc 01/05/2030                                     | 42 083           | 0,00              |
| 250 000 4.208% Benchmark 2018-B5 Mortgage Trust 15/07/2051              | 236 816          | 0,01              | 100 000 5.200% Biogen Inc 15/09/2045                                    | 101 756          | 0,01              |
|   |                  |                   | 100 000 3.150% Biogen Inc 01/05/2050                                    | 69 736           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 3.300% Bio-Rad Laboratories Inc 15/03/2027                       | 47 226           | 0,00              | 100 000 3.600% Boardwalk Pipelines LP 01/09/2032                        | 86 191           | 0,00              |
| 50 000 2.500% Black Hills Corp 15/06/2030                               | 41 772           | 0,00              | 200 000 3.500% BOC Aviation Ltd 10/10/2024                              | 194 734          | 0,01              |
| 50 000 3.200% BlackRock Inc 15/03/2027                                  | 48 161           | 0,00              | 100 000 4.875% Boeing Co 01/05/2025                                     | 99 803           | 0,01              |
| 50 000 3.250% BlackRock Inc 30/04/2029                                  | 47 603           | 0,00              | 50 000 2.196% Boeing Co 04/02/2026                                      | 46 381           | 0,00              |
| 100 000 1.900% BlackRock Inc 28/01/2031                                 | 83 819           | 0,00              | 150 000 3.100% Boeing Co 01/05/2026                                     | 142 168          | 0,01              |
| 50 000 2.500% Blackstone Holdings Finance Co LLC 10/01/2030             | 41 588           | 0,00              | 200 000 2.250% Boeing Co 15/06/2026                                     | 183 030          | 0,01              |
| 50 000 2.550% Blackstone Holdings Finance Co LLC 30/03/2032             | 39 577           | 0,00              | 50 000 2.700% Boeing Co 01/02/2027                                      | 46 119           | 0,00              |
| 50 000 5.000% Blackstone Holdings Finance Co LLC 15/06/2044             | 42 801           | 0,00              | 100 000 5.040% Boeing Co 01/05/2027                                     | 100 728          | 0,01              |
| 150 000 3.500% Blackstone Holdings Finance Co LLC 10/09/2049            | 102 606          | 0,01              | 200 000 3.200% Boeing Co 01/03/2029                                     | 182 144          | 0,01              |
| 100 000 2.850% Blackstone Holdings Finance Co LLC 05/08/2051            | 57 384           | 0,00              | 200 000 3.550% Boeing Co 01/03/2038                                     | 159 382          | 0,01              |
| 100 000 3.200% Blackstone Holdings Finance Co LLC 30/01/2052            | 63 494           | 0,00              | 90 000 6.875% Boeing Co 15/03/2039                                      | 100 486          | 0,01              |
| 50 000 7.050% Blackstone Private Credit Fund 29/09/2025                 | 49 781           | 0,00              | 150 000 5.805% Boeing Co 01/05/2050                                     | 150 814          | 0,01              |
| 225 000 4.000% Blackstone Private Credit Fund 15/01/2029                | 188 766          | 0,01              | 50 000 3.825% Boeing Co 01/03/2059                                      | 35 438           | 0,00              |
| 50 000 2.750% Blackstone Secured Lending Fund 16/09/2026                | 43 232           | 0,00              | 300 000 5.930% Boeing Co 01/05/2060                                     | 299 886          | 0,01              |
| 150 000 3.875% Block Financial LLC 15/08/2030                           | 129 663          | 0,01              | 50 000 3.600% Booking Holdings Inc 01/06/2026                           | 48 756           | 0,00              |
| 50 000 3.125% Blue Owl Finance LLC 10/06/2031                           | 37 391           | 0,00              | 100 000 4.625% Booking Holdings Inc 13/04/2030                          | 99 883           | 0,01              |
| 248 000 2.400% BMW Finance NV 14/08/2024                                | 240 384          | 0,01              | 50 000 4.000% Booz Allen Hamilton Inc 01/07/2029                        | 45 193           | 0,00              |
| 50 000 3.900% BMW US Capital LLC 09/04/2025                             | 49 078           | 0,00              | 150 000 2.650% BorgWarner Inc 01/07/2027                                | 137 769          | 0,01              |
| 250 000 4.150% BMW US Capital LLC 09/04/2030                            | 244 222          | 0,01              | 50 000 3.150% Boston Gas Co 01/08/2027                                  | 46 040           | 0,00              |
| 50 000 2.550% BMW US Capital LLC 01/04/2031                             | 42 937           | 0,00              | 50 000 4.487% Boston Gas Co 15/02/2042                                  | 43 285           | 0,00              |
| 130 000 4.375% BNP Paribas SA 28/09/2025                                | 124 955          | 0,01              | 50 000 3.400% Boston Properties LP 21/06/2029                           | 40 791           | 0,00              |
| 200 000 2.219% BNP Paribas SA 09/06/2026                                | 183 880          | 0,01              | 100 000 2.900% Boston Properties LP 15/03/2030                          | 77 228           | 0,00              |
| 200 000 2.591% BNP Paribas SA 20/01/2028                                | 179 422          | 0,01              | 200 000 3.250% Boston Properties LP 30/01/2031                          | 157 734          | 0,01              |
| 200 000 4.400% BNP Paribas SA 14/08/2028                                | 189 398          | 0,01              | 100 000 2.550% Boston Properties LP 01/04/2032                          | 71 172           | 0,00              |
| 200 000 1.904% BNP Paribas SA 30/09/2028                                | 169 966          | 0,01              | 100 000 2.450% Boston Properties LP 01/10/2033                          | 67 147           | 0,00              |
| 200 000 2.159% BNP Paribas SA 15/09/2029                                | 167 206          | 0,01              | 50 000 2.650% Boston Scientific Corp 01/06/2030                         | 44 188           | 0,00              |
| 200 000 5.198% BNP Paribas SA 10/01/2030                                | 194 306          | 0,01              | 33 000 4.700% Boston Scientific Corp 01/03/2049                         | 31 412           | 0,00              |
| 200 000 3.052% BNP Paribas SA 13/01/2031                                | 171 868          | 0,01              | 150 000 3.410% BP Capital Markets America Inc 11/02/2026                | 146 127          | 0,01              |
| 200 000 2.871% BNP Paribas SA 19/04/2032                                | 166 516          | 0,01              | 100 000 4.234% BP Capital Markets America Inc 06/11/2028                | 99 113           | 0,01              |
| 200 000 3.132% BNP Paribas SA 20/01/2033                                | 167 174          | 0,01              | 150 000 3.633% BP Capital Markets America Inc 06/04/2030                | 142 569          | 0,01              |
| 50 000 4.450% Boardwalk Pipelines LP 15/07/2027                         | 48 830           | 0,00              | 50 000 3.000% BP Capital Markets America Inc 24/02/2050                 | 35 432           | 0,00              |
| 50 000 3.400% Boardwalk Pipelines LP 15/02/2031                         | 43 635           | 0,00              | 100 000 2.939% BP Capital Markets America Inc 04/06/2051                | 69 374           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 3.001% BP Capital Markets America Inc 17/03/2052                | 70 282           | 0,00              |
| 50 000 3.379% BP Capital Markets America Inc 08/02/2061                 | 36 033           | 0,00              |
| 250 000 3.250% BPCE SA 11/01/2028                                       | 227 437          | 0,01              |
| 275 000 5.748% BPCE SA 19/07/2033                                       | 270 897          | 0,01              |
| 200 000 4.375% BPRL International Singapore Pte Ltd 18/01/2027          | 191 278          | 0,01              |
| 50 000 3.950% Brandywine Operating Partnership LP 15/11/2027            | 38 295           | 0,00              |
| 200 000 4.500% Braskem Netherlands Finance BV 31/01/2030                | 169 538          | 0,01              |
| 50 000 1.550% Brighthouse Financial Global Funding 24/05/2026           | 44 933           | 0,00              |
| 50 000 4.700% Brighthouse Financial Inc 22/06/2047                      | 36 477           | 0,00              |
| 100 000 2.900% Bristol-Myers Squibb Co 26/07/2024                       | 98 056           | 0,01              |
| 100 000 3.200% Bristol-Myers Squibb Co 15/06/2026                       | 96 704           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Bristol-Myers Squibb Co 13/11/2027                       | 87 681           | 0,00              |
| 50 000 3.900% Bristol-Myers Squibb Co 20/02/2028                        | 49 063           | 0,00              |
| 150 000 3.400% Bristol-Myers Squibb Co 26/07/2029                       | 142 417          | 0,01              |
| 100 000 2.950% Bristol-Myers Squibb Co 15/03/2032                       | 90 177           | 0,00              |
| 100 000 4.125% Bristol-Myers Squibb Co 15/06/2039                       | 93 109           | 0,00              |
| 50 000 2.350% Bristol-Myers Squibb Co 13/11/2040                        | 36 026           | 0,00              |
| 100 000 3.550% Bristol-Myers Squibb Co 15/03/2042                       | 85 206           | 0,00              |
| 50 000 4.625% Bristol-Myers Squibb Co 15/05/2044                        | 48 580           | 0,00              |
| 50 000 5.000% Bristol-Myers Squibb Co 15/08/2045                        | 50 905           | 0,00              |
| 50 000 4.350% Bristol-Myers Squibb Co 15/11/2047                        | 46 261           | 0,00              |
| 100 000 4.550% Bristol-Myers Squibb Co 20/02/2048                       | 94 611           | 0,00              |
| 100 000 3.700% Bristol-Myers Squibb Co 15/03/2052                       | 83 602           | 0,00              |
| 100 000 3.900% Bristol-Myers Squibb Co 15/03/2062                       | 82 464           | 0,00              |
| 100 000 3.850% Brixmor Operating Partnership LP 01/02/2025              | 95 849           | 0,00              |
| 50 000 4.125% Brixmor Operating Partnership LP 15/06/2026               | 47 304           | 0,00              |

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>        |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                                |                  |                   |
| 50 000 4.050% Brixmor Operating Partnership LP 01/07/2030                | 44 786           | 0,00              |
| 100 000 3.150% Broadcom Inc 15/11/2025                                   | 95 843           | 0,00              |
| 200 000 1.950% Broadcom Inc 15/02/2028                                   | 173 804          | 0,01              |
| 100 000 4.000% Broadcom Inc 15/04/2029                                   | 93 641           | 0,00              |
| 150 000 2.450% Broadcom Inc 15/02/2031                                   | 122 763          | 0,01              |
| 100 000 4.150% Broadcom Inc 15/04/2032                                   | 91 178           | 0,00              |
| 100 000 4.300% Broadcom Inc 15/11/2032                                   | 91 900           | 0,00              |
| 100 000 2.600% Broadcom Inc 15/02/2033                                   | 78 433           | 0,00              |
| 200 000 3.419% Broadcom Inc 15/04/2033                                   | 167 296          | 0,01              |
| 200 000 3.469% Broadcom Inc 15/04/2034                                   | 164 338          | 0,01              |
| 100 000 3.137% Broadcom Inc 15/11/2035                                   | 77 065           | 0,00              |
| 100 000 4.926% Broadcom Inc 15/05/2037                                   | 90 733           | 0,00              |
| 200 000 3.500% Broadcom Inc 15/02/2041                                   | 150 716          | 0,01              |
| 100 000 3.750% Broadcom Inc 15/02/2051                                   | 73 844           | 0,00              |
| 50 000 3.400% Broadridge Financial Solutions Inc 27/06/2026              | 47 861           | 0,00              |
| 100 000 2.600% Broadridge Financial Solutions Inc 01/05/2031             | 83 841           | 0,00              |
| 100 000 3.900% Brookfield Finance Inc 25/01/2028                         | 92 639           | 0,00              |
| 50 000 4.850% Brookfield Finance Inc 29/03/2029                          | 48 233           | 0,00              |
| 50 000 4.350% Brookfield Finance Inc 15/04/2030                          | 46 637           | 0,00              |
| 50 000 2.724% Brookfield Finance Inc 15/04/2031                          | 41 523           | 0,00              |
| 100 000 4.700% Brookfield Finance Inc 20/09/2047                         | 86 422           | 0,00              |
| 50 000 3.500% Brookfield Finance Inc 30/03/2051                          | 33 368           | 0,00              |
| 50 000 3.450% Brookfield Finance LLC / Brookfield Finance Inc 15/04/2050 | 33 925           | 0,00              |
| 100 000 3.407% Brooklyn Union Gas Co 10/03/2026                          | 94 754           | 0,00              |
| 50 000 4.866% Brooklyn Union Gas Co 05/08/2032                           | 48 082           | 0,00              |
| 100 000 2.375% Brown & Brown Inc 15/03/2031                              | 80 077           | 0,00              |
| 50 000 0.850% Brunswick Corp/DE 18/08/2024                               | 46 776           | 0,00              |
| 50 000 4.400% Brunswick Corp/DE 15/09/2032                               | 43 666           | 0,00              |
| 100 000 3.250% Bunge Ltd Finance Corp 15/08/2026                         | 94 855           | 0,00              |
| 100 000 2.750% Bunge Ltd Finance Corp 14/05/2031                         | 85 011           | 0,00              |
| 100 000 3.750% Burlington Northern Santa Fe LLC 01/04/2024               | 98 629           | 0,01              |
| 150 000 3.250% Burlington Northern Santa Fe LLC 15/06/2027               | 144 861          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 5.050% Burlington Northern Santa Fe LLC 01/03/2041               | 50 305           | 0,00              | 25 000 6.750% Canadian Natural Resources Ltd 01/02/2039                 | 26 684           | 0,00              |
| 50 000 5.400% Burlington Northern Santa Fe LLC 01/06/2041               | 52 104           | 0,00              | 100 000 1.350% Canadian Pacific Railway Co 02/12/2024                   | 94 258           | 0,00              |
| 50 000 4.950% Burlington Northern Santa Fe LLC 15/09/2041               | 49 721           | 0,00              | 50 000 1.750% Canadian Pacific Railway Co 02/12/2026                    | 45 418           | 0,00              |
| 50 000 4.375% Burlington Northern Santa Fe LLC 01/09/2042               | 46 222           | 0,00              | 50 000 4.000% Canadian Pacific Railway Co 01/06/2028                    | 49 184           | 0,00              |
| 200 000 4.450% Burlington Northern Santa Fe LLC 15/03/2043              | 184 810          | 0,01              | 50 000 2.450% Canadian Pacific Railway Co 02/12/2031                    | 43 285           | 0,00              |
| 50 000 4.900% Burlington Northern Santa Fe LLC 01/04/2044               | 49 024           | 0,00              | 100 000 3.000% Canadian Pacific Railway Co 02/12/2041                   | 79 782           | 0,00              |
| 50 000 3.900% Burlington Northern Santa Fe LLC 01/08/2046               | 42 328           | 0,00              | 100 000 3.100% Canadian Pacific Railway Co 02/12/2051                   | 71 821           | 0,00              |
| 50 000 4.050% Burlington Northern Santa Fe LLC 15/06/2048               | 43 850           | 0,00              | 150 000 6.125% Canadian Pacific Railway Co 15/09/2115                   | 161 277          | 0,01              |
| 50 000 4.150% Burlington Northern Santa Fe LLC 15/12/2048               | 44 067           | 0,00              | 50 000 4.875% Cantor Fitzgerald LP 01/05/2024                           | 48 643           | 0,00              |
| 100 000 4.450% Burlington Northern Santa Fe LLC 15/01/2053              | 93 434           | 0,00              | 50 000 3.750% Capital One Financial Corp 24/04/2024                     | 48 787           | 0,00              |
| 200 000 4.375% Cadence Design Systems Inc 15/10/2024                    | 197 738          | 0,01              | 50 000 3.300% Capital One Financial Corp 30/10/2024                     | 47 787           | 0,00              |
| 200 000 2.902% Cameron LNG LLC 15/07/2031                               | 177 828          | 0,01              | 100 000 3.750% Capital One Financial Corp 28/07/2026                    | 90 954           | 0,00              |
| 25 000 3.302% Cameron LNG LLC 15/01/2035                                | 21 538           | 0,00              | 125 000 3.750% Capital One Financial Corp 09/03/2027                    | 113 600          | 0,01              |
| 50 000 3.402% Cameron LNG LLC 15/01/2038                                | 43 160           | 0,00              | 100 000 3.650% Capital One Financial Corp 11/05/2027                    | 91 356           | 0,00              |
| 100 000 3.125% Campbell Soup Co 24/04/2050                              | 70 771           | 0,00              | 100 000 1.878% Capital One Financial Corp 02/11/2027                    | 86 040           | 0,00              |
| 200 000 3.945% Canadian Imperial Bank of Commerce 04/08/2025            | 195 026          | 0,01              | 200 000 3.800% Capital One Financial Corp 31/01/2028                    | 183 386          | 0,01              |
| 200 000 1.846% Canadian Imperial Bank of Commerce 19/01/2027            | 182 166          | 0,01              | 200 000 4.927% Capital One Financial Corp 10/05/2028                    | 192 258          | 0,01              |
| 100 000 3.450% Canadian Imperial Bank of Commerce 07/04/2027            | 94 890           | 0,00              | 100 000 3.273% Capital One Financial Corp 01/03/2030                    | 85 874           | 0,00              |
| 200 000 3.200% Canadian National Railway Co 02/08/2046                  | 152 164          | 0,01              | 50 000 2.359% Capital One Financial Corp 29/07/2032                     | 35 696           | 0,00              |
| 50 000 3.650% Canadian National Railway Co 03/02/2048                   | 41 401           | 0,00              | 100 000 5.268% Capital One Financial Corp 10/05/2033                    | 93 879           | 0,00              |
| 100 000 4.450% Canadian National Railway Co 20/01/2049                  | 93 458           | 0,00              | 100 000 3.079% Cardinal Health Inc 15/06/2024                           | 97 724           | 0,00              |
| 50 000 2.450% Canadian National Railway Co 01/05/2050                   | 32 703           | 0,00              | 50 000 3.750% Cardinal Health Inc 15/09/2025                            | 48 801           | 0,00              |
| 100 000 3.900% Canadian Natural Resources Ltd 01/02/2025                | 97 896           | 0,00              | 50 000 4.500% Cardinal Health Inc 15/11/2044                            | 42 808           | 0,00              |
| 100 000 2.050% Canadian Natural Resources Ltd 15/07/2025                | 93 701           | 0,00              | 100 000 3.500% Cargill Inc 22/04/2025                                   | 97 601           | 0,00              |
| 100 000 2.950% Canadian Natural Resources Ltd 15/07/2030                | 86 930           | 0,00              | 200 000 4.875% Cargill Inc 10/10/2025                                   | 201 306          | 0,01              |
| 50 000 6.500% Canadian Natural Resources Ltd 15/02/2037                 | 52 332           | 0,00              | 50 000 3.250% Cargill Inc 23/05/2029                                    | 46 347           | 0,00              |
| 100 000 6.250% Canadian Natural Resources Ltd 15/03/2038                | 104 518          | 0,01              | 50 000 1.700% Cargill Inc 02/02/2031                                    | 40 313           | 0,00              |
|   |                  |                   | 50 000 2.125% Cargill Inc 10/11/2031                                    | 41 454           | 0,00              |
|   |                  |                   | 50 000 3.750% Carlisle Cos Inc 01/12/2027                               | 47 666           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 2.200% Carisle Cos Inc 01/03/2032                                | 38 844           | 0,00              |
| 50 000 3.500% Carlyle Finance Subsidiary LLC 19/09/2029                 | 45 812           | 0,00              |
| 200 000 2.722% Carrier Global Corp 15/02/2030                           | 175 672          | 0,01              |
| 50 000 3.377% Carrier Global Corp 05/04/2040                            | 39 708           | 0,00              |
| 100 000 3.577% Carrier Global Corp 05/04/2050                           | 75 702           | 0,00              |
| 100 000 2.850% Caterpillar Financial Services Corp 17/05/2024           | 98 025           | 0,01              |
| 150 000 2.150% Caterpillar Financial Services Corp 08/11/2024           | 144 681          | 0,01              |
| 50 000 3.650% Caterpillar Financial Services Corp 12/08/2025            | 49 109           | 0,00              |
| 200 000 0.800% Caterpillar Financial Services Corp 13/11/2025           | 182 598          | 0,01              |
| 50 000 3.600% Caterpillar Financial Services Corp 12/08/2027            | 48 932           | 0,00              |
| 50 000 1.100% Caterpillar Financial Services Corp 14/09/2027            | 43 977           | 0,00              |
| 100 000 3.803% Caterpillar Inc 15/08/2042                               | 88 840           | 0,00              |
| 150 000 3.250% Caterpillar Inc 19/09/2049                               | 119 188          | 0,01              |
| 50 000 1.625% Cboe Global Markets Inc 15/12/2030                        | 40 296           | 0,00              |
| 200 000 2.000% CBQ Finance Ltd 15/09/2025                               | 185 104          | 0,01              |
| 50 000 4.875% CBRE Services Inc 01/03/2026                              | 49 302           | 0,00              |
| 92 000 2.500% CBRE Services Inc 01/04/2031                              | 72 837           | 0,00              |
| 50 000 3.050% CCL Industries Inc 01/06/2030                             | 42 513           | 0,00              |
| 200 000 3.500% CDBL Funding 1 24/10/2027                                | 189 078          | 0,01              |
| 100 000 2.670% CDW LLC / CDW Finance Corp 01/12/2026                    | 91 024           | 0,00              |
| 200 000 3.276% CDW LLC / CDW Finance Corp 01/12/2028                    | 176 738          | 0,01              |
| 100 000 3.569% CDW LLC / CDW Finance Corp 01/12/2031                    | 86 038           | 0,00              |
| 100 000 5.900% Celanese US Holdings LLC 05/07/2024                      | 100 047          | 0,01              |
| 100 000 6.050% Celanese US Holdings LLC 15/03/2025                      | 100 579          | 0,01              |
| 100 000 6.165% Celanese US Holdings LLC 15/07/2027                      | 101 096          | 0,01              |
| 100 000 6.379% Celanese US Holdings LLC 15/07/2032                      | 101 396          | 0,01              |
| 50 000 5.400% Cenovus Energy Inc 15/06/2047                             | 46 392           | 0,00              |
| 50 000 3.750% Cenovus Energy Inc 15/02/2052                             | 36 401           | 0,00              |
| 250 000 4.250% Centene Corp 15/12/2027                                  | 240 840          | 0,01              |
| 100 000 2.450% Centene Corp 15/07/2028                                  | 86 974           | 0,00              |
| 50 000 3.000% Centene Corp 15/10/2030                                   | 42 082           | 0,00              |
| 200 000 2.500% Centene Corp 01/03/2031                                  | 161 866          | 0,01              |
| 200 000 2.625% Centene Corp 01/08/2031                                  | 162 128          | 0,01              |

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>                                  |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 2.350% CenterPoint Energy Houston Electric LLC 01/04/2031  | 85 527           | 0,00              |
| 100 000 4.450% CenterPoint Energy Houston Electric LLC 01/10/2032  | 99 094           | 0,01              |
| 50 000 4.250% CenterPoint Energy Houston Electric LLC 01/02/2049   | 44 444           | 0,00              |
| 50 000 3.350% CenterPoint Energy Houston Electric LLC 01/04/2051   | 38 007           | 0,00              |
| 50 000 5.250% CenterPoint Energy Resources Corp 01/03/2028   | 51 274           | 0,00              |
| 224 000 1.750% CenterPoint Energy Resources Corp 01/10/2030  | 181 205          | 0,01              |
| 50 000 4.500% CF Industries Inc 01/12/2026   | 48 719           | 0,00              |
| 50 000 5.375% CF Industries Inc 15/03/2044   | 45 170           | 0,00              |
| 48 000 3.283% CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 10/05/2058   | 44 479           | 0,00              |
| 200 000 2.950% Champion MTN Ltd 15/06/2030   | 171 968          | 0,01              |
| 100 000 1.150% Charles Schwab Corp 13/05/2026  | 87 772           | 0,00              |
| 50 000 3.200% Charles Schwab Corp 02/03/2027   | 46 284           | 0,00              |
| 50 000 3.300% Charles Schwab Corp 01/04/2027   | 46 207           | 0,00              |
| 50 000 3.200% Charles Schwab Corp 25/01/2028   | 45 752           | 0,00              |
| 100 000 2.000% Charles Schwab Corp 20/03/2028  | 85 903           | 0,00              |
| 150 000 4.000% Charles Schwab Corp 01/02/2029  | 143 335          | 0,01              |
| 50 000 1.650% Charles Schwab Corp 11/03/2031   | 38 553           | 0,00              |
| 200 000 1.950% Charles Schwab Corp 01/12/2031  | 154 246          | 0,01              |
| 100 000 2.900% Charles Schwab Corp 03/03/2032  | 83 436           | 0,00              |
| 200 000 4.375% Charming Light Investments Ltd 21/12/2027   | 187 690          | 0,01              |
| 50 000 3.750% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 15/02/2028 | 46 359           | 0,00              |
| 50 000 5.050% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 30/03/2029 | 48 293           | 0,00              |
| 50 000 2.800% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 01/04/2031 | 40 236           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>   |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>   |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>                                   |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>                                   |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 150 000 6.384% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 23/10/2035 | 148 863          | 0,01              | 100 000 3.950% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 30/06/2062 | 62 931           | 0,00              |
| 100 000 5.375% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 01/04/2038 | 86 985           | 0,00              | 100 000 5.500% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 01/04/2063 | 80 904           | 0,00              |
| 100 000 3.500% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 01/06/2041 | 68 380           | 0,00              | 200 000 5.875% Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 31/03/2025  | 201 454          | 0,01              |
| 100 000 3.500% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 01/03/2042 | 67 536           | 0,00              | 100 000 3.700% Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 15/11/2029  | 92 077           | 0,00              |
| 50 000 5.375% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 01/05/2047  | 41 101           | 0,00              | 100 000 4.000% Cheniere Energy Partners LP 01/03/2031   | 89 051           | 0,00              |
| 100 000 5.750% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 01/04/2048 | 85 859           | 0,00              | 150 000 1.554% Chevron Corp 11/05/2025  | 141 480          | 0,01              |
| 300 000 5.125% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 01/07/2049 | 236 937          | 0,01              | 100 000 2.954% Chevron Corp 16/05/2026  | 96 318           | 0,00              |
| 50 000 4.800% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 01/03/2050  | 38 037           | 0,00              | 100 000 1.995% Chevron Corp 11/05/2027  | 91 815           | 0,00              |
| 100 000 3.700% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 01/04/2051 | 63 852           | 0,00              | 100 000 2.236% Chevron Corp 11/05/2030  | 88 425           | 0,00              |
| 100 000 3.900% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 01/06/2052 | 65 875           | 0,00              | 150 000 3.078% Chevron Corp 11/05/2050  | 113 536          | 0,01              |
| 150 000 5.250% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 01/04/2053 | 121 285          | 0,01              | 100 000 2.511% Children's Health System of Texas 15/08/2050   | 64 215           | 0,00              |
| 50 000 6.834% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 23/10/2055  | 48 509           | 0,00              | 50 000 2.585% Children's Hospital Corp 01/02/2050   | 33 025           | 0,00              |
| 200 000 3.850% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 01/04/2061 | 124 098          | 0,01              | 50 000 4.268% Children's Hospital Medical Center/Cincinnati OH 15/05/2044                                 | 46 703           | 0,00              |
| 50 000 4.400% Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 01/12/2061  | 33 996           | 0,00              | 200 000 2.704% Children's Hospital of Philadelphia 01/07/2050   | 132 680          | 0,01              |
|   |                  |                   | 200 000 3.000% China Cinda 2020 I Management Ltd 18/03/2027   | 181 582          | 0,01              |
|   |                  |                   | 200 000 3.000% China Cinda 2020 I Management Ltd 20/01/2031   | 158 462          | 0,01              |
|   |                  |                   | 50 000 4.250% China Cinda Finance 2015 I Ltd 23/04/2025   | 48 574           | 0,00              |
|   |                  |                   | 200 000 4.000% China Clean Energy Development Ltd 05/11/2025  | 195 508          | 0,01              |
|   |                  |                   | 200 000 2.450% China Construction Bank Corp 24/06/2030  | 188 478          | 0,01              |
|   |                  |                   | 200 000 2.600% China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd 10/12/2024                   | 193 012          | 0,01              |
|   |                  |                   | 200 000 2.750% China Overseas Finance Cayman VIII Ltd 02/03/2030  | 172 812          | 0,01              |
|   |                  |                   | 200 000 3.250% China Railway Xunjie Co Ltd 28/07/2026   | 191 554          | 0,01              |
|   |                  |                   | 50 000 3.700% Choice Hotels International Inc 01/12/2029  | 45 004           | 0,00              |
|   |                  |                   | 50 000 3.700% Choice Hotels International Inc 15/01/2031  | 44 318           | 0,00              |
|   |                  |                   | 50 000 6.500% Chubb Corp 15/05/2038   | 57 690           | 0,00              |
|   |                  |                   | 150 000 3.350% Chubb INA Holdings Inc 03/05/2026  | 145 336          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 2.850% Chubb INA Holdings Inc 15/12/2051                        | 70 400           | 0,00              |
| 100 000 3.050% Chubb INA Holdings Inc 15/12/2061                        | 67 696           | 0,00              |
| 233 000 3.200% CI Financial Corp 17/12/2030                             | 179 380          | 0,01              |
| 100 000 4.100% CI Financial Corp 15/06/2051                             | 60 322           | 0,00              |
| 100 000 3.500% Cigna Group 15/06/2024                                   | 98 121           | 0,01              |
| 50 000 3.250% Cigna Group 15/04/2025                                    | 48 464           | 0,00              |
| 250 000 4.125% Cigna Group 15/11/2025                                   | 246 147          | 0,01              |
| 150 000 4.375% Cigna Group 15/10/2028                                   | 147 750          | 0,01              |
| 50 000 2.400% Cigna Group 15/03/2030                                    | 43 379           | 0,00              |
| 50 000 2.375% Cigna Group 15/03/2031                                    | 42 249           | 0,00              |
| 50 000 3.200% Cigna Group 15/03/2040                                    | 39 174           | 0,00              |
| 100 000 4.800% Cigna Group 15/07/2046                                   | 91 637           | 0,00              |
| 75 000 3.875% Cigna Group 15/10/2047                                    | 60 451           | 0,00              |
| 100 000 3.400% Cigna Group 15/03/2050                                   | 73 918           | 0,00              |
| 100 000 3.400% Cigna Group 15/03/2051                                   | 73 574           | 0,00              |
| 50 000 2.500% Cisco Systems Inc 20/09/2026                              | 47 224           | 0,00              |
| 200 000 5.500% Cisco Systems Inc 15/01/2040                             | 218 480          | 0,01              |
| 100 000 4.875% Citadel LP 15/01/2027                                    | 96 269           | 0,00              |
| 200 000 2.850% CITIC Ltd 25/02/2030                                     | 176 024          | 0,01              |
| 250 000 3.137% Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 10/02/2048 | 239 440          | 0,01              |
| 135 259 2.575% Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C2 10/08/2049   | 124 631          | 0,01              |
| 300 000 4.228% Citigroup Commercial Mortgage Trust 2018-C5 10/06/2051   | 286 029          | 0,01              |
| 50 000 3.300% Citigroup Inc 27/04/2025                                  | 48 254           | 0,00              |
| 200 000 0.981% Citigroup Inc 01/05/2025                                 | 190 184          | 0,01              |
| 100 000 4.140% Citigroup Inc 24/05/2025                                 | 98 319           | 0,01              |
| 200 000 4.400% Citigroup Inc 10/06/2025                                 | 194 938          | 0,01              |
| 100 000 1.281% Citigroup Inc 03/11/2025                                 | 93 393           | 0,00              |
| 50 000 3.700% Citigroup Inc 12/01/2026                                  | 48 448           | 0,00              |
| 100 000 2.014% Citigroup Inc 25/01/2026                                 | 94 188           | 0,00              |
| 100 000 4.600% Citigroup Inc 09/03/2026                                 | 98 116           | 0,01              |
| 100 000 3.290% Citigroup Inc 17/03/2026                                 | 96 033           | 0,00              |
| 250 000 3.106% Citigroup Inc 08/04/2026                                 | 239 042          | 0,01              |
| 100 000 5.610% Citigroup Inc 29/09/2026                                 | 100 595          | 0,01              |
| 250 000 4.300% Citigroup Inc 20/11/2026                                 | 242 225          | 0,01              |
| 400 000 1.122% Citigroup Inc 28/01/2027                                 | 357 344          | 0,01              |
| 100 000 1.462% Citigroup Inc 09/06/2027                                 | 88 854           | 0,00              |
| 100 000 4.450% Citigroup Inc 29/09/2027                                 | 96 980           | 0,00              |
| 50 000 3.887% Citigroup Inc 10/01/2028                                  | 47 862           | 0,00              |
| 50 000 3.070% Citigroup Inc 24/02/2028                                  | 46 514           | 0,00              |
| 100 000 4.658% Citigroup Inc 24/05/2028                                 | 98 872           | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 3.668% Citigroup Inc 24/07/2028                                  | 47 363           | 0,00              |
| 100 000 4.125% Citigroup Inc 25/07/2028                                 | 94 660           | 0,00              |
| 100 000 4.075% Citigroup Inc 23/04/2029                                 | 95 298           | 0,00              |
| 100 000 3.980% Citigroup Inc 20/03/2030                                 | 93 387           | 0,00              |
| 100 000 2.976% Citigroup Inc 05/11/2030                                 | 87 642           | 0,00              |
| 200 000 2.666% Citigroup Inc 29/01/2031                                 | 170 858          | 0,01              |
| 100 000 2.561% Citigroup Inc 01/05/2032                                 | 82 855           | 0,00              |
| 150 000 2.520% Citigroup Inc 03/11/2032                                 | 122 571          | 0,01              |
| 100 000 3.057% Citigroup Inc 25/01/2033                                 | 84 861           | 0,00              |
| 100 000 3.785% Citigroup Inc 17/03/2033                                 | 89 670           | 0,00              |
| 300 000 4.910% Citigroup Inc 24/05/2033                                 | 294 024          | 0,01              |
| 100 000 6.270% Citigroup Inc 17/11/2033                                 | 108 157          | 0,01              |
| 200 000 3.878% Citigroup Inc 24/01/2039                                 | 170 040          | 0,01              |
| 100 000 5.875% Citigroup Inc 30/01/2042                                 | 106 158          | 0,01              |
| 100 000 2.904% Citigroup Inc 03/11/2042                                 | 71 480           | 0,00              |
| 100 000 4.650% Citigroup Inc 30/07/2045                                 | 91 039           | 0,00              |
| 100 000 4.750% Citigroup Inc 18/05/2046                                 | 88 582           | 0,00              |
| 150 000 4.281% Citigroup Inc 24/04/2048                                 | 129 915          | 0,01              |
| 50 000 4.650% Citigroup Inc 23/07/2048                                  | 46 324           | 0,00              |
| 50 000 2.850% Citizens Financial Group Inc 27/07/2026                   | 42 697           | 0,00              |
| 50 000 3.250% Citizens Financial Group Inc 30/04/2030                   | 41 439           | 0,00              |
| 150 000 5.641% Citizens Financial Group Inc 21/05/2037                  | 138 117          | 0,01              |
| 100 000 5.623% City of Hope 15/11/2043                                  | 101 723          | 0,01              |
| 200 000 3.250% CK Hutchison International 19 Ltd 11/04/2024             | 197 036          | 0,01              |
| 200 000 3.625% CK Hutchison International 19 Ltd 11/04/2029             | 189 126          | 0,01              |
| 200 000 1.375% CK Property Finance MTN Ltd 30/06/2026                   | 179 596          | 0,01              |
| 50 000 3.743% Cleco Corporate Holdings LLC 01/05/2026                   | 47 509           | 0,00              |
| 50 000 3.100% Clorox Co 01/10/2027                                      | 47 362           | 0,00              |
| 250 000 1.800% Clorox Co 15/05/2030                                     | 206 830          | 0,01              |
| 200 000 1.875% CMB International Leasing Management Ltd 12/08/2025      | 185 102          | 0,01              |
| 100 000 4.150% CME Group Inc 15/06/2048                                 | 92 156           | 0,00              |
| 200 000 4.500% CNA Financial Corp 01/03/2026                            | 198 048          | 0,01              |
| 50 000 3.450% CNA Financial Corp 15/08/2027                             | 47 179           | 0,00              |
| 50 000 3.900% CNA Financial Corp 01/05/2029                             | 47 188           | 0,00              |
| 200 000 3.375% CNAC HK Finbridge Co Ltd 19/06/2024                      | 195 494          | 0,01              |
| 200 000 3.875% CNAC HK Finbridge Co Ltd 19/06/2029                      | 182 736          | 0,01              |



## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 5.450% CNH Industrial Capital LLC 14/10/2025                     | 50 606           | 0,00              |
| 50 000 1.875% CNH Industrial Capital LLC 15/01/2026                     | 46 035           | 0,00              |
| 50 000 1.450% CNH Industrial Capital LLC 15/07/2026                     | 44 809           | 0,00              |
| 150 000 1.650% CNO Global Funding 06/01/2025                            | 141 000          | 0,01              |
| 150 000 2.650% CNO Global Funding 06/01/2029                            | 130 519          | 0,01              |
| 150 000 3.375% Coca-Cola Co 25/03/2027                                  | 147 438          | 0,01              |
| 100 000 2.900% Coca-Cola Co 25/05/2027                                  | 95 804           | 0,00              |
| 100 000 1.450% Coca-Cola Co 01/06/2027                                  | 90 800           | 0,00              |
| 50 000 2.125% Coca-Cola Co 06/09/2029                                   | 44 895           | 0,00              |
| 100 000 3.450% Coca-Cola Co 25/03/2030                                  | 95 997           | 0,00              |
| 50 000 2.000% Coca-Cola Co 05/03/2031                                   | 42 771           | 0,00              |
| 100 000 3.000% Coca-Cola Co 05/03/2051                                  | 77 529           | 0,00              |
| 200 000 0.800% Coca-Cola Europacific Partners PLC 03/05/2024            | 190 346          | 0,01              |
| 150 000 1.850% Coca-Cola Femsa SAB de CV 01/09/2032                     | 117 199          | 0,01              |
| 50 000 3.700% Colgate-Palmolive Co 01/08/2047                           | 45 355           | 0,00              |
| 150 000 3.250% Colonial Enterprises Inc 15/05/2030                      | 134 245          | 0,01              |
| 50 000 4.250% Colonial Pipeline Co 15/04/2048                           | 44 046           | 0,00              |
| 50 000 5.800% Columbia Pipeline Group Inc 01/06/2045                    | 50 640           | 0,00              |
| 50 000 3.700% Comcast Corp 15/04/2024                                   | 49 420           | 0,00              |
| 150 000 3.950% Comcast Corp 15/10/2025                                  | 148 299          | 0,01              |
| 50 000 3.150% Comcast Corp 01/03/2026                                   | 48 499           | 0,00              |
| 50 000 2.350% Comcast Corp 15/01/2027                                   | 46 609           | 0,00              |
| 200 000 3.300% Comcast Corp 01/02/2027                                  | 193 076          | 0,01              |
| 250 000 4.150% Comcast Corp 15/10/2028                                  | 247 335          | 0,01              |
| 200 000 3.400% Comcast Corp 01/04/2030                                  | 186 988          | 0,01              |
| 200 000 4.250% Comcast Corp 15/10/2030                                  | 195 960          | 0,01              |
| 100 000 1.950% Comcast Corp 15/01/2031                                  | 83 137           | 0,00              |
| 150 000 5.500% Comcast Corp 15/11/2032                                  | 159 937          | 0,01              |
| 100 000 5.650% Comcast Corp 15/06/2035                                  | 107 359          | 0,01              |
| 11 000 6.500% Comcast Corp 15/11/2035                                   | 12 608           | 0,00              |
| 50 000 3.200% Comcast Corp 15/07/2036                                   | 42 140           | 0,00              |
| 100 000 3.900% Comcast Corp 01/03/2038                                  | 89 806           | 0,00              |
| 50 000 3.250% Comcast Corp 01/11/2039                                   | 40 440           | 0,00              |
| 50 000 4.750% Comcast Corp 01/03/2044                                   | 47 314           | 0,00              |
| 50 000 4.600% Comcast Corp 15/08/2045                                   | 46 187           | 0,00              |
| 50 000 3.400% Comcast Corp 15/07/2046                                   | 38 643           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 4.000% Comcast Corp 15/08/2047                                   | 42 269           | 0,00              |
| 100 000 3.969% Comcast Corp 01/11/2047                                  | 84 377           | 0,00              |
| 100 000 4.000% Comcast Corp 01/03/2048                                  | 84 673           | 0,00              |
| 50 000 4.700% Comcast Corp 15/10/2048                                   | 47 411           | 0,00              |
| 50 000 3.450% Comcast Corp 01/02/2050                                   | 38 527           | 0,00              |
| 50 000 2.800% Comcast Corp 15/01/2051                                   | 33 784           | 0,00              |
| 200 000 2.887% Comcast Corp 01/11/2051                                  | 136 482          | 0,01              |
| 100 000 2.450% Comcast Corp 15/08/2052                                  | 62 431           | 0,00              |
| 100 000 4.049% Comcast Corp 01/11/2052                                  | 84 303           | 0,00              |
| 50 000 2.937% Comcast Corp 01/11/2056                                   | 33 322           | 0,00              |
| 100 000 2.650% Comcast Corp 15/08/2062                                  | 60 939           | 0,00              |
| 150 000 2.987% Comcast Corp 01/11/2063                                  | 97 329           | 0,00              |
| 171 400 6.375% Cometa Energia SA de CV 24/04/2035                       | 162 141          | 0,01              |
| 200 000 6.125% Comision Federal de Electricidad 16/06/2045              | 171 794          | 0,01              |
| 225 000 3.838% COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust 10/09/2047                 | 217 612          | 0,01              |
| 350 000 3.078% COMM 2015-DC1 Mortgage Trust 10/02/2048                  | 337 273          | 0,01              |
| 450 000 3.902% COMM 2015-PC1 Mortgage Trust 10/07/2050                  | 434 664          | 0,02              |
| 125 000 4.228% COMM 2018-COR3 Mortgage Trust 10/05/2051                 | 118 846          | 0,01              |
| 100 000 4.350% CommonSpirit Health 01/11/2042                           | 85 484           | 0,00              |
| 100 000 3.817% CommonSpirit Health 01/10/2049                           | 77 519           | 0,00              |
| 100 000 3.910% CommonSpirit Health 01/10/2050                           | 77 249           | 0,00              |
| 250 000 3.214% Commonwealth Bank of Australia 27/05/2025                | 242 547          | 0,01              |
| 150 000 1.125% Commonwealth Bank of Australia 15/06/2026                | 134 389          | 0,01              |
| 200 000 2.688% Commonwealth Bank of Australia 11/03/2031                | 158 442          | 0,01              |
| 200 000 3.784% Commonwealth Bank of Australia 14/03/2032                | 168 536          | 0,01              |
| 200 000 3.610% Commonwealth Bank of Australia 12/09/2034                | 173 128          | 0,01              |
| 200 000 3.743% Commonwealth Bank of Australia 12/09/2039                | 153 488          | 0,01              |
| 250 000 4.316% Commonwealth Bank of Australia 10/01/2048                | 193 585          | 0,01              |
| 50 000 2.950% Commonwealth Edison Co 15/08/2027                         | 46 941           | 0,00              |
| 50 000 2.200% Commonwealth Edison Co 01/03/2030                         | 42 948           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 6.450% Commonwealth Edison Co 15/01/2038                         | 57 901           | 0,00              |
| 100 000 3.800% Commonwealth Edison Co 01/10/2042                        | 84 363           | 0,00              |
| 100 000 3.750% Commonwealth Edison Co 15/08/2047                        | 81 497           | 0,00              |
| 100 000 4.000% Commonwealth Edison Co 01/03/2048                        | 85 081           | 0,00              |
| 100 000 3.125% Commonwealth Edison Co 15/03/2051                        | 71 830           | 0,00              |
| 100 000 3.099% Community Health Network Inc 01/05/2050                  | 67 339           | 0,00              |
| 200 000 4.250% Competition Team Technologies Ltd 12/03/2029             | 191 658          | 0,01              |
| 50 000 4.300% Conagra Brands Inc 01/05/2024                             | 49 524           | 0,00              |
| 200 000 4.600% Conagra Brands Inc 01/11/2025                            | 198 136          | 0,01              |
| 100 000 1.375% Conagra Brands Inc 01/11/2027                            | 85 734           | 0,00              |
| 100 000 5.300% Conagra Brands Inc 01/11/2038                            | 98 125           | 0,01              |
| 50 000 5.400% Conagra Brands Inc 01/11/2048                             | 48 982           | 0,00              |
| 150 000 2.400% ConocoPhillips Co 07/03/2025                             | 143 974          | 0,01              |
| 200 000 3.800% ConocoPhillips Co 15/03/2052                             | 165 610          | 0,01              |
| 149 000 4.025% ConocoPhillips Co 15/03/2062                             | 121 392          | 0,01              |
| 100 000 5.300% Consolidated Edison Co of New York Inc 01/03/2035        | 101 568          | 0,01              |
| 50 000 5.700% Consolidated Edison Co of New York Inc 15/06/2040         | 51 487           | 0,00              |
| 100 000 4.500% Consolidated Edison Co of New York Inc 01/12/2045        | 89 572           | 0,00              |
| 50 000 4.650% Consolidated Edison Co of New York Inc 01/12/2048         | 45 628           | 0,00              |
| 50 000 4.125% Consolidated Edison Co of New York Inc 15/05/2049         | 42 256           | 0,00              |
| 100 000 3.950% Consolidated Edison Co of New York Inc 01/04/2050        | 83 157           | 0,00              |
| 150 000 4.300% Consolidated Edison Co of New York Inc 01/12/2056        | 125 946          | 0,01              |
| 150 000 3.700% Consolidated Edison Co of New York Inc 15/11/2059        | 112 666          | 0,01              |
| 100 000 3.000% Consolidated Edison Co of New York Inc 01/12/2060        | 65 622           | 0,00              |
| 50 000 4.400% Constellation Brands Inc 15/11/2025                       | 49 344           | 0,00              |
| 50 000 3.700% Constellation Brands Inc 06/12/2026                       | 48 428           | 0,00              |
| 50 000 3.500% Constellation Brands Inc 09/05/2027                       | 48 199           | 0,00              |
| 50 000 4.350% Constellation Brands Inc 09/05/2027                       | 49 359           | 0,00              |
| 50 000 3.600% Constellation Brands Inc 15/02/2028                       | 47 576           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 4.650% Constellation Brands Inc 15/11/2028                       | 49 887           | 0,00              |
| 50 000 3.150% Constellation Brands Inc 01/08/2029                       | 45 737           | 0,00              |
| 50 000 2.875% Constellation Brands Inc 01/05/2030                       | 43 831           | 0,00              |
| 100 000 2.250% Constellation Brands Inc 01/08/2031                      | 82 139           | 0,00              |
| 50 000 5.250% Constellation Brands Inc 15/11/2048                       | 48 418           | 0,00              |
| 100 000 3.250% Constellation Energy Generation LLC 01/06/2025           | 96 507           | 0,00              |
| 75 000 6.250% Constellation Energy Generation LLC 01/10/2039            | 79 269           | 0,00              |
| 50 000 5.600% Constellation Energy Generation LLC 15/06/2042            | 49 280           | 0,00              |
| 100 000 4.050% Consumers Energy Co 15/05/2048                           | 85 493           | 0,00              |
| 100 000 4.350% Consumers Energy Co 15/04/2049                           | 90 820           | 0,00              |
| 50 000 4.200% Consumers Energy Co 01/09/2052                            | 43 836           | 0,00              |
| 50 000 2.500% Consumers Energy Co 01/05/2060                            | 29 259           | 0,00              |
| 100 000 2.268% Continental Resources Inc/OK 15/11/2026                  | 88 647           | 0,00              |
| 100 000 5.750% Continental Resources Inc/OK 15/01/2031                  | 95 968           | 0,00              |
| 50 000 2.875% Continental Resources Inc/OK 01/04/2032                   | 38 818           | 0,00              |
| 250 000 1.339% Cooperatieve Rabobank UA 24/06/2026                      | 227 800          | 0,01              |
| 250 000 1.980% Cooperatieve Rabobank UA 15/12/2027                      | 221 125          | 0,01              |
| 250 000 4.655% Cooperatieve Rabobank UA 22/08/2028                      | 243 327          | 0,01              |
| 250 000 1.375% Cooperatieve Rabobank UA/NY 10/01/2025                   | 234 917          | 0,01              |
| 50 000 3.500% Corebridge Financial Inc 04/04/2025                       | 48 090           | 0,00              |
| 100 000 3.850% Corebridge Financial Inc 05/04/2029                      | 91 216           | 0,00              |
| 100 000 3.900% Corebridge Financial Inc 05/04/2032                      | 86 503           | 0,00              |
| 50 000 4.350% Corebridge Financial Inc 05/04/2042                       | 41 133           | 0,00              |
| 100 000 4.400% Corebridge Financial Inc 05/04/2052                      | 78 159           | 0,00              |
| 50 000 6.875% Corebridge Financial Inc 15/12/2052                       | 44 075           | 0,00              |
| 150 000 3.900% Coming Inc 15/11/2049                                    | 115 816          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 1.250% Corp Andina de Fomento 26/10/2024                         | 47 195           | 0,00              |
| 200 000 5.125% Corp Nacional del Cobre de Chile 02/02/2033              | 201 512          | 0,01              |
| 250 000 3.150% Corp Nacional del Cobre de Chile 15/01/2051              | 177 125          | 0,01              |
| 50 000 2.750% Corporate Office Properties LP 15/04/2031                 | 37 044           | 0,00              |
| 100 000 2.800% CoStar Group Inc 15/07/2030                              | 83 772           | 0,00              |
| 50 000 2.750% Costco Wholesale Corp 18/05/2024                          | 48 939           | 0,00              |
| 25 000 3.000% Costco Wholesale Corp 18/05/2027                          | 24 084           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Costco Wholesale Corp 20/06/2027                         | 89 745           | 0,00              |
| 150 000 3.304% Cottage Health Obligated Group 01/11/2049                | 111 078          | 0,01              |
| 350 000 3.000% Council Of Europe Development Bank 16/06/2025            | 341 834          | 0,01              |
| 100 000 0.875% Council Of Europe Development Bank 22/09/2026            | 90 354           | 0,00              |
| 100 000 3.150% Cox Communications Inc 15/08/2024                        | 97 406           | 0,00              |
| 50 000 3.350% Cox Communications Inc 15/09/2026                         | 47 481           | 0,00              |
| 200 000 1.800% Cox Communications Inc 01/10/2030                        | 157 596          | 0,01              |
| 100 000 4.800% Cox Communications Inc 01/02/2035                        | 92 550           | 0,00              |
| 97 000 4.500% Cox Communications Inc 30/06/2043                         | 81 691           | 0,00              |
| 250 000 2.015% Credit Agricole SA 11/01/2027                            | 222 275          | 0,01              |
| 250 000 2.811% Credit Agricole SA 11/01/2041                            | 168 237          | 0,01              |
| 250 000 3.625% Credit Suisse AG/New York NY 09/09/2024                  | 238 927          | 0,01              |
| 250 000 3.700% Credit Suisse AG/New York NY 21/02/2025                  | 237 305          | 0,01              |
| 250 000 2.950% Credit Suisse AG/New York NY 09/04/2025                  | 232 287          | 0,01              |
| 250 000 1.250% Credit Suisse AG/New York NY 07/08/2026                  | 211 660          | 0,01              |
| 100 000 7.500% Credit Suisse AG/New York NY 15/02/2028                  | 106 078          | 0,01              |
| 250 000 1.305% Credit Suisse Group AG 02/02/2027                        | 212 900          | 0,01              |
| 250 000 4.194% Credit Suisse Group AG 01/04/2031                        | 220 322          | 0,01              |
| 250 000 6.537% Credit Suisse Group AG 12/08/2033                        | 257 470          | 0,01              |
| 250 000 9.016% Credit Suisse Group AG 15/11/2033                        | 297 122          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 200 000 4.500% CRH America Finance Inc 04/04/2048                       | 172 354          | 0,01              |
| 200 000 3.875% CRH America Inc 18/05/2025                               | 194 634          | 0,01              |
| 50 000 3.800% Crown Castle Inc 15/02/2028                               | 47 498           | 0,00              |
| 100 000 4.300% Crown Castle Inc 15/02/2029                              | 96 293           | 0,00              |
| 150 000 2.250% Crown Castle Inc 15/01/2031                              | 124 372          | 0,01              |
| 100 000 2.100% Crown Castle Inc 01/04/2031                              | 81 557           | 0,00              |
| 100 000 2.900% Crown Castle Inc 01/04/2041                              | 71 301           | 0,00              |
| 50 000 5.200% Crown Castle Inc 15/02/2049                               | 46 334           | 0,00              |
| 50 000 4.150% Crown Castle Inc 01/07/2050                               | 39 985           | 0,00              |
| 50 000 3.250% Crown Castle Inc 15/01/2051                               | 34 452           | 0,00              |
| 400 000 3.504% Csail 2015-C2 Commercial Mortgage Trust 15/06/2057       | 382 857          | 0,02              |
| 25 000 3.718% CSAIL 2015-C3 Commercial Mortgage Trust 15/08/2048        | 23 943           | 0,00              |
| 100 000 3.392% CSAIL 2017-C8 Commercial Mortgage Trust 15/06/2050       | 92 457           | 0,00              |
| 50 000 4.422% CSAIL 2018-C14 Commercial Mortgage Trust 15/11/2051       | 47 774           | 0,00              |
| 100 000 4.250% CSL Finance PLC 27/04/2032                               | 96 888           | 0,00              |
| 100 000 4.750% CSL Finance PLC 27/04/2052                               | 94 312           | 0,00              |
| 100 000 3.250% CSX Corp 01/06/2027                                      | 95 626           | 0,00              |
| 50 000 3.800% CSX Corp 01/03/2028                                       | 48 783           | 0,00              |
| 100 000 4.100% CSX Corp 15/11/2032                                      | 96 325           | 0,00              |
| 100 000 6.220% CSX Corp 30/04/2040                                      | 110 676          | 0,01              |
| 50 000 4.750% CSX Corp 15/11/2048                                       | 46 888           | 0,00              |
| 50 000 4.500% CSX Corp 15/03/2049                                       | 45 425           | 0,00              |
| 100 000 3.350% CSX Corp 15/09/2049                                      | 75 558           | 0,00              |
| 100 000 3.950% CSX Corp 01/05/2050                                      | 83 684           | 0,00              |
| 50 000 4.500% CSX Corp 15/11/2052                                       | 45 746           | 0,00              |
| 50 000 4.375% CubeSmart LP 15/02/2029                                   | 47 875           | 0,00              |
| 50 000 2.000% CubeSmart LP 15/02/2031                                   | 39 387           | 0,00              |
| 50 000 2.500% CubeSmart LP 15/02/2032                                   | 40 210           | 0,00              |
| 50 000 1.500% Cummins Inc 01/09/2030                                    | 40 923           | 0,00              |
| 50 000 4.875% Cummins Inc 01/10/2043                                    | 48 409           | 0,00              |
| 200 000 2.625% CVS Health Corp 15/08/2024                               | 194 206          | 0,01              |
| 150 000 4.100% CVS Health Corp 25/03/2025                               | 148 962          | 0,01              |
| 200 000 3.875% CVS Health Corp 20/07/2025                               | 196 412          | 0,01              |
| 100 000 2.875% CVS Health Corp 01/06/2026                               | 95 023           | 0,00              |
| 200 000 4.300% CVS Health Corp 25/03/2028                               | 196 438          | 0,01              |
| 100 000 1.750% CVS Health Corp 21/08/2030                               | 81 287           | 0,00              |
| 50 000 2.125% CVS Health Corp 15/09/2031                                | 40 813           | 0,00              |
| 50 000 5.250% CVS Health Corp 21/02/2033                                | 50 927           | 0,00              |
| 200 000 4.780% CVS Health Corp 25/03/2038                               | 190 560          | 0,01              |
| 50 000 6.125% CVS Health Corp 15/09/2039                                | 52 857           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 250 000 4.125% CVS Health Corp 01/04/2040                               | 215 037          | 0,01              | 150 000 2.552% Deutsche Bank AG/New York NY 07/01/2028                  | 127 773          | 0,01              |
| 50 000 2.700% CVS Health Corp 21/08/2040                                | 35 784           | 0,00              | 275 000 3.742% Deutsche Bank AG/New York NY 07/01/2033                  | 199 774          | 0,01              |
| 100 000 5.300% CVS Health Corp 05/12/2043                               | 98 262           | 0,01              | 50 000 8.750% Deutsche Telekom International Finance BV 15/06/2030      | 61 100           | 0,00              |
| 100 000 5.125% CVS Health Corp 20/07/2045                               | 94 775           | 0,00              | 100 000 9.250% Deutsche Telekom International Finance BV 01/06/2032     | 130 072          | 0,01              |
| 100 000 5.050% CVS Health Corp 25/03/2048                               | 93 573           | 0,00              | 150 000 4.750% Deutsche Telekom International Finance BV 21/06/2038     | 141 031          | 0,01              |
| 100 000 4.250% CVS Health Corp 01/04/2050                               | 83 240           | 0,00              | 100 000 5.850% Devon Energy Corp 15/12/2025                             | 101 606          | 0,01              |
| 200 000 3.750% DAE Sukuk Dfc Ltd 15/02/2026                             | 191 764          | 0,01              | 50 000 4.500% Devon Energy Corp 15/01/2030                              | 47 755           | 0,00              |
| 150 000 3.500% Daimler Truck Finance North America LLC 07/04/2025       | 145 371          | 0,01              | 100 000 5.600% Devon Energy Corp 15/07/2041                             | 95 796           | 0,00              |
| 100 000 3.350% Danaher Corp 15/09/2025                                  | 97 882           | 0,00              | 50 000 5.000% Devon Energy Corp 15/06/2045                              | 44 482           | 0,00              |
| 50 000 2.600% Danaher Corp 01/10/2050                                   | 34 213           | 0,00              | 250 000 0.500% Dexia Credit Local SA 16/07/2024                         | 237 237          | 0,01              |
| 50 000 2.800% Danaher Corp 10/12/2051                                   | 35 049           | 0,00              | 300 000 1.125% Dexia Credit Local SA 09/04/2026                         | 273 600          | 0,01              |
| 200 000 0.976% Danske Bank A/S 10/09/2025                               | 186 036          | 0,01              | 50 000 2.200% DH Europe Finance II Sarl 15/11/2024                      | 48 004           | 0,00              |
| 200 000 4.298% Danske Bank A/S 01/04/2028                               | 188 362          | 0,01              | 100 000 3.250% DH Europe Finance II Sarl 15/11/2039                     | 83 758           | 0,00              |
| 200 000 3.300% DBS Group Holdings Ltd (Perpetual)                       | 186 680          | 0,01              | 200 000 5.300% Diageo Capital PLC 24/10/2027                            | 207 966          | 0,01              |
| 100 000 5.625% DCP Midstream Operating LP 15/07/2027                    | 101 370          | 0,01              | 200 000 2.000% Diageo Capital PLC 29/04/2030                            | 170 410          | 0,01              |
| 100 000 6.750% DCP Midstream Operating LP 15/09/2037                    | 108 686          | 0,01              | 100 000 5.875% Diageo Capital PLC 30/09/2036                            | 109 634          | 0,01              |
| 50 000 3.900% Deere & Co 09/06/2042                                     | 45 956           | 0,00              | 50 000 3.250% Diamondback Energy Inc 01/12/2026                         | 47 491           | 0,00              |
| 100 000 2.875% Deere & Co 07/09/2049                                    | 75 432           | 0,00              | 50 000 3.500% Diamondback Energy Inc 01/12/2029                         | 45 785           | 0,00              |
| 50 000 3.750% Deere & Co 15/04/2050                                     | 44 354           | 0,00              | 100 000 6.250% Diamondback Energy Inc 15/03/2033                        | 105 815          | 0,01              |
| 100 000 4.900% Dell International LLC / EMC Corp 01/10/2026             | 99 453           | 0,01              | 50 000 4.400% Diamondback Energy Inc 24/03/2051                         | 40 259           | 0,00              |
| 100 000 5.300% Dell International LLC / EMC Corp 01/10/2029             | 100 630          | 0,01              | 100 000 4.250% Diamondback Energy Inc 15/03/2052                        | 78 444           | 0,00              |
| 81 000 8.100% Dell International LLC / EMC Corp 15/07/2036              | 94 163           | 0,00              | 200 000 2.950% DIB Sukuk Ltd 16/01/2026                                 | 189 228          | 0,01              |
| 100 000 3.375% Dell International LLC / EMC Corp 15/12/2041             | 69 968           | 0,00              | 50 000 4.100% Dick's Sporting Goods Inc 15/01/2052                      | 35 367           | 0,00              |
| 25 000 8.350% Dell International LLC / EMC Corp 15/07/2046              | 30 415           | 0,00              | 50 000 3.700% Digital Realty Trust LP 15/08/2027                        | 46 184           | 0,00              |
| 50 000 3.450% Dell International LLC / EMC Corp 15/12/2051              | 32 566           | 0,00              | 50 000 4.500% Dignity Health 01/11/2042                                 | 44 013           | 0,00              |
| 100 000 7.000% Delta Air Lines Inc 01/05/2025                           | 102 793          | 0,01              | 200 000 4.500% Discover Financial Services 30/01/2026                   | 192 998          | 0,01              |
| 100 000 4.750% Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd 20/10/2028         | 95 931           | 0,00              | 50 000 4.100% Discover Financial Services 09/02/2027                    | 47 246           | 0,00              |
| 50 000 3.250% DENTSPLY SIRONA Inc 01/06/2030                            | 44 329           | 0,00              | 50 000 4.900% Discovery Communications LLC 11/03/2026                   | 49 674           | 0,00              |
| 200 000 1.447% Deutsche Bank AG/New York NY 01/04/2025                  | 186 226          | 0,01              | 100 000 3.950% Discovery Communications LLC 20/03/2028                  | 93 707           | 0,00              |
| 150 000 3.961% Deutsche Bank AG/New York NY 26/11/2025                  | 141 810          | 0,01              |   |                  |                   |
| 100 000 4.100% Deutsche Bank AG/New York NY 13/01/2026                  | 91 078           | 0,00              |   |                  |                   |
| 150 000 2.129% Deutsche Bank AG/New York NY 24/11/2026                  | 129 073          | 0,01              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>   |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>                                   |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 4.125% Discovery Communications LLC 15/04/2029   | 46 494           | 0,00              | 100 000 2.529% DTE Energy Co 01/10/2024                                 | 96 231           | 0,00              |
| 150 000 3.625% Discovery Communications LLC 15/05/2030  | 133 222          | 0,01              | 50 000 2.850% DTE Energy Co 01/10/2026                                  | 46 828           | 0,00              |
| 50 000 4.875% Discovery Communications LLC 01/04/2043   | 40 584           | 0,00              | 50 000 2.950% Duke Energy Carolinas LLC 01/12/2026                      | 47 290           | 0,00              |
| 100 000 5.200% Discovery Communications LLC 20/09/2047  | 82 424           | 0,00              | 50 000 2.450% Duke Energy Carolinas LLC 15/08/2029                      | 43 690           | 0,00              |
| 150 000 5.300% Discovery Communications LLC 15/05/2049  | 125 128          | 0,01              | 50 000 2.450% Duke Energy Carolinas LLC 01/02/2030                      | 43 778           | 0,00              |
| 100 000 4.000% Discovery Communications LLC 15/09/2055  | 66 369           | 0,00              | 100 000 2.550% Duke Energy Carolinas LLC 15/04/2031                     | 85 904           | 0,00              |
| 200 000 0.856% DNB Bank ASA 30/09/2025  | 186 694          | 0,01              | 50 000 4.000% Duke Energy Carolinas LLC 30/09/2042                      | 42 788           | 0,00              |
| 200 000 1.535% DNB Bank ASA 25/05/2027  | 177 610          | 0,01              | 50 000 3.750% Duke Energy Carolinas LLC 01/06/2045                      | 40 671           | 0,00              |
| 50 000 4.500% Doctors Co An Interinsurance Exchange 18/01/2032  | 41 311           | 0,00              | 50 000 3.950% Duke Energy Carolinas LLC 15/03/2048                      | 41 733           | 0,00              |
| 50 000 3.875% Dollar General Corp 15/04/2027  | 48 801           | 0,00              | 100 000 3.200% Duke Energy Carolinas LLC 15/08/2049                     | 73 520           | 0,00              |
| 50 000 3.500% Dollar General Corp 03/04/2030  | 45 995           | 0,00              | 100 000 3.750% Duke Energy Corp 15/04/2024                              | 98 853           | 0,01              |
| 100 000 4.125% Dollar General Corp 03/04/2050   | 81 354           | 0,00              | 200 000 0.900% Duke Energy Corp 15/09/2025                              | 181 926          | 0,01              |
| 200 000 4.200% Dollar Tree Inc 15/05/2028   | 194 626          | 0,01              | 100 000 2.650% Duke Energy Corp 01/09/2026                              | 93 665           | 0,00              |
| 150 000 3.375% Dominion Energy Inc 01/04/2030   | 135 951          | 0,01              | 100 000 4.500% Duke Energy Corp 15/08/2032                              | 96 637           | 0,00              |
| 100 000 5.250% Dominion Energy Inc 01/08/2033   | 100 801          | 0,01              | 50 000 4.800% Duke Energy Corp 15/12/2045                               | 46 340           | 0,00              |
| 100 000 5.950% Dominion Energy Inc 15/06/2035   | 105 788          | 0,01              | 100 000 3.750% Duke Energy Corp 01/09/2046                              | 77 997           | 0,00              |
| 50 000 2.300% Dominion Energy South Carolina Inc 01/12/2031   | 41 478           | 0,00              | 100 000 3.950% Duke Energy Corp 15/08/2047                              | 79 211           | 0,00              |
| 50 000 4.600% Dominion Energy South Carolina Inc 15/06/2043   | 46 153           | 0,00              | 50 000 4.200% Duke Energy Corp 15/06/2049                               | 40 861           | 0,00              |
| 115 000 4.800% Dow Chemical Co 30/11/2028   | 115 757          | 0,01              | 100 000 3.500% Duke Energy Corp 15/06/2051                              | 73 426           | 0,00              |
| 50 000 2.100% Dow Chemical Co 15/11/2030  | 41 801           | 0,00              | 100 000 5.000% Duke Energy Corp 15/08/2052                              | 93 052           | 0,00              |
| 200 000 5.250% Dow Chemical Co 15/11/2041   | 194 208          | 0,01              | 100 000 3.800% Duke Energy Florida LLC 15/07/2028                       | 97 735           | 0,00              |
| 100 000 4.625% Dow Chemical Co 01/10/2044   | 89 338           | 0,00              | 50 000 6.350% Duke Energy Florida LLC 15/09/2037                        | 55 822           | 0,00              |
| 100 000 4.800% Dow Chemical Co 15/05/2049   | 88 689           | 0,00              | 100 000 6.400% Duke Energy Florida LLC 15/06/2038                       | 113 741          | 0,01              |
| 100 000 3.600% Dow Chemical Co 15/11/2050   | 74 787           | 0,00              | 50 000 6.450% Duke Energy Indiana LLC 01/04/2039                        | 55 739           | 0,00              |
| 200 000 4.848% DP World Crescent Ltd 26/09/2028   | 199 018          | 0,01              | 100 000 2.750% Duke Energy Indiana LLC 01/04/2050                       | 66 151           | 0,00              |
| 50 000 2.600% DR Horton Inc 15/10/2025  | 46 789           | 0,00              | 50 000 3.700% Duke Energy Ohio Inc 15/06/2046                           | 38 288           | 0,00              |
| 250 000 3.875% Drawbridge Special Opportunities Fund LP / Drawbridge Special Opportunities Fin 15/02/2026 | 221 127          | 0,01              | 50 000 3.250% Duke Energy Progress LLC 15/08/2025                       | 48 575           | 0,00              |
| 50 000 2.250% DTE Electric Co 01/03/2030  | 43 361           | 0,00              | 100 000 4.200% Duke Energy Progress LLC 15/08/2045                      | 86 043           | 0,00              |
| 50 000 3.000% DTE Electric Co 01/03/2032  | 43 953           | 0,00              | 100 000 2.832% Duke University 01/10/2055                               | 70 412           | 0,00              |
| 50 000 5.200% DTE Electric Co 01/04/2033  | 51 639           | 0,00              | 50 000 3.920% Duke University Health System Inc 01/06/2047              | 43 254           | 0,00              |
| 50 000 3.700% DTE Electric Co 15/03/2045  | 40 711           | 0,00              | 50 000 4.493% DuPont de Nemours Inc 15/11/2025                          | 49 960           | 0,00              |
| 100 000 2.950% DTE Electric Co 01/03/2050   | 70 290           | 0,00              |   |                  |                   |
| 100 000 3.250% DTE Electric Co 01/04/2051   | 74 177           | 0,00              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 150 000 4.725% DuPont de Nemours Inc 15/11/2028                         | 151 378          | 0,01              | 50 000 2.875% Elevance Health Inc 15/09/2029                            | 45 331           | 0,00              |
| 50 000 5.319% DuPont de Nemours Inc 15/11/2038                          | 50 345           | 0,00              | 100 000 2.550% Elevance Health Inc 15/03/2031                           | 85 968           | 0,00              |
| 100 000 5.419% DuPont de Nemours Inc 15/11/2048                         | 100 052          | 0,01              | 50 000 5.500% Elevance Health Inc 15/10/2032                            | 52 526           | 0,00              |
| 100 000 2.375% DXC Technology Co 15/09/2028                             | 84 843           | 0,00              | 50 000 4.650% Elevance Health Inc 15/01/2043                            | 46 836           | 0,00              |
| 100 000 2.500% Eagle Materials Inc 01/07/2031                           | 82 007           | 0,00              | 150 000 5.100% Elevance Health Inc 15/01/2044                           | 146 224          | 0,01              |
| 50 000 1.300% East Ohio Gas Co 15/06/2025                               | 45 944           | 0,00              | 100 000 4.375% Elevance Health Inc 01/12/2047                           | 89 193           | 0,00              |
| 100 000 2.000% East Ohio Gas Co 15/06/2030                              | 81 906           | 0,00              | 150 000 4.550% Elevance Health Inc 01/03/2048                           | 136 638          | 0,01              |
| 50 000 3.000% East Ohio Gas Co 15/06/2050                               | 33 294           | 0,00              | 100 000 3.600% Elevance Health Inc 15/03/2051                           | 78 230           | 0,00              |
| 50 000 3.800% Eastman Chemical Co 15/03/2025                            | 48 763           | 0,00              | 150 000 3.100% Eli Lilly & Co 15/05/2027                                | 144 226          | 0,01              |
| 150 000 4.500% Eastman Chemical Co 01/12/2028                           | 147 097          | 0,01              | 100 000 3.950% Eli Lilly & Co 15/03/2049                                | 91 254           | 0,00              |
| 50 000 4.800% Eastman Chemical Co 01/09/2042                            | 44 767           | 0,00              | 150 000 2.250% Eli Lilly & Co 15/05/2050                                | 99 037           | 0,01              |
| 50 000 4.650% Eastman Chemical Co 15/10/2044                            | 43 315           | 0,00              | 200 000 3.250% EMD Finance LLC 19/03/2025                               | 193 800          | 0,01              |
| 50 000 4.150% Eaton Corp 02/11/2042                                     | 44 174           | 0,00              | 100 000 4.750% Emera US Finance LP 15/06/2046                           | 81 354           | 0,00              |
| 50 000 3.450% eBay Inc 01/08/2024                                       | 48 989           | 0,00              | 50 000 1.800% Emerson Electric Co 15/10/2027                            | 44 778           | 0,00              |
| 50 000 4.828% eBay Inc 11/03/2025                                       | 47 295           | 0,00              | 50 000 2.000% Emerson Electric Co 21/12/2028                            | 44 305           | 0,00              |
| 50 000 1.400% eBay Inc 10/05/2026                                       | 45 377           | 0,00              | 100 000 2.750% Emerson Electric Co 15/10/2050                           | 67 391           | 0,00              |
| 50 000 3.600% eBay Inc 05/06/2027                                       | 47 837           | 0,00              | 200 000 2.800% Emerson Electric Co 21/12/2051                           | 136 756          | 0,01              |
| 50 000 2.700% eBay Inc 11/03/2030                                       | 43 790           | 0,00              | 200 000 1.639% Emirates Development Bank PJSC 15/06/2026                | 180 602          | 0,01              |
| 100 000 3.650% eBay Inc 10/05/2051                                      | 74 799           | 0,00              | 200 000 1.638% Emirates NBD Bank PJSC 13/01/2026                        | 184 286          | 0,01              |
| 100 000 2.700% Ecolab Inc 01/11/2026                                    | 94 865           | 0,00              | 50 000 2.969% Emory University 01/09/2050                               | 36 574           | 0,00              |
| 50 000 1.650% Ecolab Inc 01/02/2027                                     | 45 322           | 0,00              | 150 000 3.650% Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA 07/05/2030   | 139 686          | 0,01              |
| 100 000 3.250% Ecolab Inc 01/12/2027                                    | 95 624           | 0,00              | 50 000 5.000% Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA 25/01/2047    | 45 706           | 0,00              |
| 200 000 4.125% Edison International 15/03/2028                          | 190 096          | 0,01              | 50 000 5.500% Enbridge Energy Partners LP 15/09/2040                    | 48 375           | 0,00              |
| 200 000 3.625% EDP Finance BV 15/07/2024                                | 195 564          | 0,01              | 200 000 2.500% Enbridge Inc 15/01/2025                                  | 191 920          | 0,01              |
| 50 000 4.300% Edwards Lifesciences Corp 15/06/2028                      | 49 796           | 0,00              | 50 000 1.600% Enbridge Inc 04/10/2026                                   | 44 845           | 0,00              |
| 200 000 1.827% El Sukuk Co Ltd 23/09/2025                               | 184 822          | 0,01              | 100 000 3.125% Enbridge Inc 15/11/2029                                  | 90 158           | 0,00              |
| 200 000 3.545% EIG Pearl Holdings Sarl 31/08/2036                       | 171 264          | 0,01              | 50 000 4.000% Enel Americas SA 25/10/2026                               | 48 128           | 0,00              |
| 400 000 3.625% Electricite de France SA 13/10/2025                      | 389 224          | 0,02              | 200 000 1.375% Enel Finance International NV 12/07/2026                 | 178 210          | 0,01              |
| 200 000 4.875% Electricite de France SA 22/01/2044                      | 171 156          | 0,01              | 200 000 2.250% Enel Finance International NV 12/07/2031                 | 156 164          | 0,01              |
| 200 000 5.000% Electricite de France SA 21/09/2048                      | 174 208          | 0,01              | 150 000 5.000% Enel Finance International NV 15/06/2032                 | 140 572          | 0,01              |
| 150 000 6.000% Electricite de France SA 22/01/2114                      | 141 646          | 0,01              | 200 000 6.800% Enel Finance International NV 15/09/2037                 | 213 416          | 0,01              |
| 50 000 1.850% Electronic Arts Inc 15/02/2031                            | 41 142           | 0,00              | 250 000 6.000% Enel Finance International NV 07/10/2039                 | 244 777          | 0,01              |
| 50 000 3.350% Elevance Health Inc 01/12/2024                            | 48 832           | 0,00              |   |                  |                   |
| 125 000 3.650% Elevance Health Inc 01/12/2027                           | 120 775          | 0,01              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 4.250% Enel Generacion Chile SA 15/04/2024                      | 98 844           | 0,01              |
| 50 000 4.750% Energy Transfer LP 15/01/2026                             | 49 422           | 0,00              |
| 50 000 4.400% Energy Transfer LP 15/03/2027                             | 48 620           | 0,00              |
| 100 000 5.250% Energy Transfer LP 15/04/2029                            | 99 749           | 0,01              |
| 150 000 3.750% Energy Transfer LP 15/05/2030                            | 138 391          | 0,01              |
| 75 000 5.800% Energy Transfer LP 15/06/2038                             | 72 850           | 0,00              |
| 100 000 5.300% Energy Transfer LP 15/04/2047                            | 87 821           | 0,00              |
| 100 000 5.400% Energy Transfer LP 01/10/2047                            | 89 037           | 0,00              |
| 50 000 6.000% Energy Transfer LP 15/06/2048                             | 47 674           | 0,00              |
| 100 000 6.250% Energy Transfer LP 15/04/2049                            | 99 032           | 0,01              |
| 150 000 5.000% Energy Transfer LP 15/05/2050                            | 127 629          | 0,01              |
| 200 000 4.250% Eni SpA 09/05/2029                                       | 188 732          | 0,01              |
| 200 000 3.100% Enstar Group Ltd 01/09/2031                              | 154 660          | 0,01              |
| 50 000 4.750% Entegris Escrow Corp 15/04/2029                           | 47 187           | 0,00              |
| 50 000 3.700% Entergy Arkansas LLC 01/06/2024                           | 49 277           | 0,00              |
| 50 000 3.500% Entergy Arkansas LLC 01/04/2026                           | 48 719           | 0,00              |
| 50 000 3.350% Entergy Arkansas LLC 15/06/2052                           | 36 799           | 0,00              |
| 50 000 1.900% Entergy Corp 15/06/2028                                   | 43 539           | 0,00              |
| 100 000 2.400% Entergy Corp 15/06/2031                                  | 82 827           | 0,00              |
| 100 000 3.750% Entergy Corp 15/06/2050                                  | 75 708           | 0,00              |
| 150 000 2.400% Entergy Louisiana LLC 01/10/2026                         | 138 433          | 0,01              |
| 100 000 4.000% Entergy Louisiana LLC 15/03/2033                         | 93 652           | 0,00              |
| 50 000 4.950% Entergy Louisiana LLC 15/01/2045                          | 46 352           | 0,00              |
| 50 000 4.200% Entergy Louisiana LLC 01/09/2048                          | 43 403           | 0,00              |
| 50 000 4.500% Entergy Texas Inc 30/03/2039                              | 45 579           | 0,00              |
| 150 000 3.700% Enterprise Products Operating LLC 15/02/2026             | 146 458          | 0,01              |
| 150 000 4.150% Enterprise Products Operating LLC 16/10/2028             | 145 740          | 0,01              |
| 100 000 3.125% Enterprise Products Operating LLC 31/07/2029             | 91 532           | 0,00              |
| 100 000 2.800% Enterprise Products Operating LLC 31/01/2030             | 88 864           | 0,00              |
| 100 000 5.950% Enterprise Products Operating LLC 01/02/2041             | 105 636          | 0,01              |
| 50 000 4.450% Enterprise Products Operating LLC 15/02/2043              | 44 381           | 0,00              |
| 50 000 4.850% Enterprise Products Operating LLC 15/03/2044              | 46 374           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 5.100% Enterprise Products Operating LLC 15/02/2045             | 95 350           | 0,00              |
| 50 000 4.200% Enterprise Products Operating LLC 31/01/2050              | 42 432           | 0,00              |
| 100 000 3.200% Enterprise Products Operating LLC 15/02/2052             | 71 050           | 0,00              |
| 100 000 3.300% Enterprise Products Operating LLC 15/02/2053             | 72 517           | 0,00              |
| 100 000 3.950% Enterprise Products Operating LLC 31/01/2060             | 77 514           | 0,00              |
| 50 000 4.375% EOG Resources Inc 15/04/2030                              | 49 886           | 0,00              |
| 50 000 3.900% EOG Resources Inc 01/04/2035                              | 45 847           | 0,00              |
| 50 000 4.750% EPR Properties 15/12/2026                                 | 43 543           | 0,00              |
| 100 000 4.950% EPR Properties 15/04/2028                                | 83 820           | 0,00              |
| 50 000 3.900% EQT Corp 01/10/2027                                       | 46 977           | 0,00              |
| 100 000 5.700% EQT Corp 01/04/2028                                      | 100 236          | 0,01              |
| 50 000 3.625% EQT Corp 15/05/2031                                       | 43 358           | 0,00              |
| 50 000 3.100% Equifax Inc 15/05/2030                                    | 43 552           | 0,00              |
| 150 000 2.350% Equifax Inc 15/09/2031                                   | 120 718          | 0,01              |
| 50 000 1.450% Equinix Inc 15/05/2026                                    | 45 042           | 0,00              |
| 100 000 3.200% Equinix Inc 18/11/2029                                   | 89 297           | 0,00              |
| 150 000 2.150% Equinix Inc 15/07/2030                                   | 122 550          | 0,01              |
| 100 000 2.500% Equinix Inc 15/05/2031                                   | 82 376           | 0,00              |
| 100 000 2.875% Equinor ASA 06/04/2025                                   | 96 974           | 0,00              |
| 50 000 3.000% Equinor ASA 06/04/2027                                    | 47 464           | 0,00              |
| 150 000 7.250% Equinor ASA 23/09/2027                                   | 168 006          | 0,01              |
| 50 000 5.100% Equinor ASA 17/08/2040                                    | 51 527           | 0,00              |
| 150 000 3.700% Equinor ASA 06/04/2050                                   | 126 963          | 0,01              |
| 50 000 1.000% Equitable Financial Life Global Funding 09/01/2026        | 45 020           | 0,00              |
| 157 000 1.300% Equitable Financial Life Global Funding 12/07/2026       | 138 592          | 0,01              |
| 50 000 1.800% Equitable Financial Life Global Funding 08/03/2028        | 42 475           | 0,00              |
| 100 000 4.350% Equitable Holdings Inc 20/04/2028                        | 96 129           | 0,00              |
| 50 000 5.000% Equitable Holdings Inc 20/04/2048                         | 42 821           | 0,00              |
| 200 000 3.800% ERAC USA Finance LLC 01/11/2025                          | 193 384          | 0,01              |
| 50 000 6.700% ERAC USA Finance LLC 01/06/2034                           | 56 780           | 0,00              |
| 50 000 3.500% ERP Operating LP 01/03/2028                               | 46 958           | 0,00              |
| 50 000 3.000% ERP Operating LP 01/07/2029                               | 44 503           | 0,00              |
| 150 000 2.500% ERP Operating LP 15/02/2030                              | 128 839          | 0,01              |
| 200 000 3.939% Esic Sukuk Ltd 30/07/2024                                | 194 620          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>              |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>        |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>        |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                                      |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                                |                  |                   |
| 50 000 2.950% Essential Properties LP<br>15/07/2031                            | 36 907           | 0,00              | 50 000 4.100% Evergy Kansas Central Inc<br>01/04/2043                    | 43 944           | 0,00              |
| 50 000 2.704% Essential Utilities Inc<br>15/04/2030                            | 43 233           | 0,00              | 100 000 4.125% Evergy Metro Inc 01/04/2049                               | 84 317           | 0,00              |
| 50 000 2.400% Essential Utilities Inc<br>01/05/2031                            | 41 516           | 0,00              | 100 000 2.900% Eversource Energy 01/10/2024                              | 96 603           | 0,00              |
| 100 000 3.351% Essential Utilities Inc<br>15/04/2050                           | 71 310           | 0,00              | 115 000 3.150% Eversource Energy 15/01/2025                              | 111 564          | 0,01              |
| 100 000 4.000% Essex Portfolio LP 01/03/2029                                   | 94 163           | 0,00              | 100 000 2.900% Eversource Energy 01/03/2027                              | 93 339           | 0,00              |
| 50 000 3.000% Essex Portfolio LP 15/01/2030                                    | 43 909           | 0,00              | 100 000 4.600% Eversource Energy 01/07/2027                              | 100 114          | 0,01              |
| 150 000 2.375% Estee Lauder Cos Inc<br>01/12/2029                              | 132 688          | 0,01              | 250 000 3.400% Exelon Corp 15/04/2026                                    | 240 415          | 0,01              |
| 100 000 3.125% Estee Lauder Cos Inc<br>01/12/2049                              | 76 870           | 0,00              | 100 000 5.625% Exelon Corp 15/06/2035                                    | 104 432          | 0,01              |
| 50 000 1.500% European Bank for<br>Reconstruction & Development<br>13/02/2025  | 47 625           | 0,00              | 100 000 4.700% Exelon Corp 15/04/2050                                    | 90 689           | 0,00              |
| 300 000 0.500% European Bank for<br>Reconstruction & Development<br>19/05/2025 | 278 118          | 0,01              | 88 000 6.250% Expedia Group Inc 01/05/2025                               | 89 179           | 0,00              |
| 200 000 0.500% European Bank for<br>Reconstruction & Development<br>28/01/2026 | 181 870          | 0,01              | 175 000 3.800% Expedia Group Inc 15/02/2028                              | 165 839          | 0,01              |
| 400 000 2.250% European Investment Bank<br>24/06/2024                          | 389 680          | 0,02              | 50 000 2.019% Exxon Mobil Corp 16/08/2024                                | 48 363           | 0,00              |
| 475 000 1.875% European Investment Bank<br>10/02/2025                          | 455 867          | 0,02              | 100 000 2.709% Exxon Mobil Corp 06/03/2025                               | 97 070           | 0,00              |
| 350 000 1.625% European Investment Bank<br>14/03/2025                          | 333 882          | 0,01              | 50 000 2.992% Exxon Mobil Corp 19/03/2025                                | 48 657           | 0,00              |
| 200 000 2.875% European Investment Bank<br>13/06/2025                          | 195 196          | 0,01              | 50 000 2.275% Exxon Mobil Corp 16/08/2026                                | 46 955           | 0,00              |
| 200 000 0.625% European Investment Bank<br>25/07/2025                          | 185 396          | 0,01              | 200 000 3.482% Exxon Mobil Corp 19/03/2030                               | 191 090          | 0,01              |
| 100 000 2.750% European Investment Bank<br>15/08/2025                          | 97 292           | 0,00              | 50 000 2.610% Exxon Mobil Corp 15/10/2030                                | 44 909           | 0,00              |
| 200 000 0.375% European Investment Bank<br>26/03/2026                          | 180 632          | 0,01              | 50 000 2.995% Exxon Mobil Corp 16/08/2039                                | 40 458           | 0,00              |
| 200 000 0.750% European Investment Bank<br>26/10/2026                          | 179 844          | 0,01              | 100 000 4.227% Exxon Mobil Corp 19/03/2040                               | 93 746           | 0,00              |
| 200 000 1.375% European Investment Bank<br>15/03/2027                          | 182 748          | 0,01              | 100 000 3.567% Exxon Mobil Corp 06/03/2045                               | 82 987           | 0,00              |
| 200 000 3.250% European Investment Bank<br>15/11/2027                          | 196 200          | 0,01              | 75 000 4.114% Exxon Mobil Corp 01/03/2046                                | 67 553           | 0,00              |
| 1 000 000 3.875% European Investment Bank<br>15/03/2028                        | 1 007 800        | 0,04              | 100 000 3.452% Exxon Mobil Corp 15/04/2051                               | 79 817           | 0,00              |
| 240 000 4.875% European Investment Bank<br>15/02/2036                          | 265 966          | 0,01              | 100 000 0.900% F&G Global Funding<br>20/09/2024                          | 93 266           | 0,00              |
| 100 000 3.125% Everest Reinsurance Holdings<br>Inc 15/10/2052                  | 67 537           | 0,00              | 90 000 2.300% F&G Global Funding<br>11/04/2027                           | 80 156           | 0,00              |
| 100 000 4.125% Evergy Kansas Central Inc<br>01/03/2042                         | 86 354           | 0,00              | 200 000 4.581% Fab Sukuk Co Ltd 17/01/2028                               | 199 032          | 0,01              |
|  |                  |                   | 50 000 2.900% FactSet Research Systems Inc<br>01/03/2027                 | 46 490           | 0,00              |
|  |                  |                   | 50 000 4.850% Fairfax Financial Holdings Ltd<br>17/04/2028               | 48 991           | 0,00              |
|  |                  |                   | 50 000 4.625% Fairfax Financial Holdings Ltd<br>29/04/2030               | 47 139           | 0,00              |
|  |                  |                   | 50 000 3.375% Fairfax Financial Holdings Ltd<br>03/03/2031               | 41 960           | 0,00              |
|  |                  |                   | 50 000 5.625% Fairfax Financial Holdings Ltd<br>16/08/2032               | 49 186           | 0,00              |
|  |                  |                   | 100 000 5.454% Farmers Exchange Capital III<br>15/10/2054                | 91 349           | 0,00              |
|  |                  |                   | 100 000 4.747% Farmers Insurance Exchange<br>01/11/2057                  | 79 435           | 0,00              |
|  |                  |                   | 50 000 3.500% Federal Realty Investment Trust<br>01/06/2030              | 44 117           | 0,00              |
|  |                  |                   | 200 000 2.050% Federation des Caisses<br>Desjardins du Quebec 10/02/2025 | 188 900          | 0,01              |
|  |                  |                   | 100 000 3.250% FedEx Corp 01/04/2026                                     | 97 074           | 0,00              |



## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 4.900% FedEx Corp 15/01/2034                                    | 99 978           | 0,01              | 100 000 2.875% Florida Power & Light Co 04/12/2051                      | 70 401           | 0,00              |
| 50 000 3.900% FedEx Corp 01/02/2035                                     | 44 928           | 0,00              | 50 000 3.500% Flowserve Corp 01/10/2030                                 | 43 388           | 0,00              |
| 100 000 4.400% FedEx Corp 15/01/2047                                    | 85 991           | 0,00              | 50 000 3.450% FMC Corp 01/10/2029                                       | 45 438           | 0,00              |
| 50 000 4.050% FedEx Corp 15/02/2048                                     | 40 623           | 0,00              | 50 000 4.500% FMC Corp 01/10/2049                                       | 41 786           | 0,00              |
| 100 000 5.250% FedEx Corp 15/05/2050                                    | 97 987           | 0,00              | 125 000 4.060% Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A 15/11/2030    | 120 908          | 0,01              |
| 43 316 1.875% FedEx Corp 2020-1 Class AA Pass Through Trust 20/08/2035  | 36 159           | 0,00              | 50 000 2.815% Ford Foundation 01/06/2070                                | 31 106           | 0,00              |
| 200 000 3.250% Ferguson Finance PLC 02/06/2030                          | 173 810          | 0,01              | 50 000 1.000% Fortinet Inc 15/03/2026                                   | 44 947           | 0,00              |
| 100 000 1.650% Fidelity National Information Services Inc 01/03/2028    | 85 478           | 0,00              | 50 000 2.200% Fortinet Inc 15/03/2031                                   | 41 543           | 0,00              |
| 100 000 2.250% Fidelity National Information Services Inc 01/03/2031    | 80 124           | 0,00              | 100 000 3.055% Fortis Inc/Canada 04/10/2026                             | 93 771           | 0,00              |
| 100 000 5.100% Fidelity National Information Services Inc 15/07/2032    | 97 491           | 0,00              | 50 000 3.250% Fortune Brands Innovations Inc 15/09/2029                 | 44 374           | 0,00              |
| 50 000 2.375% Fifth Third Bancorp 28/01/2025                            | 46 455           | 0,00              | 100 000 4.709% Fox Corp 25/01/2029                                      | 99 113           | 0,01              |
| 100 000 6.361% Fifth Third Bancorp 27/10/2028                           | 100 620          | 0,01              | 50 000 5.576% Fox Corp 25/01/2049                                       | 47 823           | 0,00              |
| 100 000 4.772% Fifth Third Bancorp 28/07/2030                           | 92 285           | 0,00              | 50 000 1.600% Franklin Resources Inc 30/10/2030                         | 39 434           | 0,00              |
| 50 000 8.250% Fifth Third Bancorp 01/03/2038                            | 56 479           | 0,00              | 100 000 4.125% Freeport-McMoRan Inc 01/03/2028                          | 94 124           | 0,00              |
| 100 000 6.125% First-Citizens Bank & Trust Co 09/03/2028                | 97 425           | 0,00              | 200 000 3.000% Fresenius Medical Care US Finance III Inc 01/12/2031     | 154 492          | 0,01              |
| 100 000 4.350% FirstEnergy Transmission LLC 15/01/2025                  | 98 418           | 0,01              | 200 000 4.250% Fresno PLC 02/10/2050                                    | 150 926          | 0,01              |
| 75 000 4.550% FirstEnergy Transmission LLC 01/04/2049                   | 63 126           | 0,00              | 150 000 4.250% FS KKR Capital Corp 14/02/2025                           | 140 454          | 0,01              |
| 150 000 3.200% Fiserv Inc 01/07/2026                                    | 142 375          | 0,01              | 50 000 2.625% FS KKR Capital Corp 15/01/2027                            | 42 062           | 0,00              |
| 50 000 2.250% Fiserv Inc 01/06/2027                                     | 45 276           | 0,00              | 50 000 3.125% FS KKR Capital Corp 12/10/2028                            | 40 808           | 0,00              |
| 100 000 4.200% Fiserv Inc 01/10/2028                                    | 96 885           | 0,00              | 50 000 1.625% GA Global Funding Trust 15/01/2026                        | 45 092           | 0,00              |
| 100 000 3.500% Fiserv Inc 01/07/2029                                    | 92 812           | 0,00              | 200 000 2.250% GA Global Funding Trust 06/01/2027                       | 178 804          | 0,01              |
| 150 000 2.650% Fiserv Inc 01/06/2030                                    | 128 976          | 0,01              | 200 000 5.000% Gaci First Investment Co 13/10/2027                      | 202 746          | 0,01              |
| 100 000 4.400% Fiserv Inc 01/07/2049                                    | 85 050           | 0,00              | 200 000 5.250% Gaci First Investment Co 13/10/2032                      | 207 634          | 0,01              |
| 50 000 3.750% Flex Ltd 01/02/2026                                       | 48 019           | 0,00              | 200 000 3.400% GAIF Bond Issuer Pty Ltd 30/09/2026                      | 188 800          | 0,01              |
| 50 000 4.875% Flex Ltd 15/06/2029                                       | 48 396           | 0,00              | 200 000 2.625% Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 31/03/2036              | 164 100          | 0,01              |
| 100 000 2.300% Florida Gas Transmission Co LLC 01/10/2031               | 81 541           | 0,00              | 379 940 2.940% Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 30/09/2040              | 307 850          | 0,01              |
| 100 000 2.450% Florida Power & Light Co 03/02/2032                      | 85 528           | 0,00              | 150 000 4.550% GATX Corp 07/11/2028                                     | 146 976          | 0,01              |
| 100 000 4.050% Florida Power & Light Co 01/06/2042                      | 89 002           | 0,00              | 100 000 5.600% GE HealthCare Technologies Inc 15/11/2025                | 101 241          | 0,01              |
| 100 000 4.050% Florida Power & Light Co 01/10/2044                      | 88 087           | 0,00              | 100 000 5.857% GE HealthCare Technologies Inc 15/03/2030                | 104 641          | 0,01              |
| 50 000 3.700% Florida Power & Light Co 01/12/2047                       | 41 413           | 0,00              | 100 000 5.905% GE HealthCare Technologies Inc 22/11/2032                | 106 314          | 0,01              |
| 50 000 3.950% Florida Power & Light Co 01/03/2048                       | 43 144           | 0,00              |   |                  |                   |
| 100 000 4.125% Florida Power & Light Co 01/06/2048                      | 87 812           | 0,00              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 6.377% GE HealthCare Technologies Inc 22/11/2052                | 111 698          | 0,01              |
| 100 000 3.500% General Dynamics Corp 15/05/2025                         | 98 045           | 0,01              |
| 100 000 2.125% General Dynamics Corp 15/08/2026                         | 93 672           | 0,00              |
| 50 000 3.750% General Dynamics Corp 15/05/2028                          | 48 868           | 0,00              |
| 100 000 3.625% General Dynamics Corp 01/04/2030                         | 95 782           | 0,00              |
| 50 000 4.250% General Dynamics Corp 01/04/2040                          | 47 193           | 0,00              |
| 50 000 6.750% General Electric Co 15/03/2032                            | 56 769           | 0,00              |
| 14 000 6.875% General Electric Co 10/01/2039                            | 16 209           | 0,00              |
| 50 000 4.350% General Electric Co 01/05/2050                            | 43 697           | 0,00              |
| 200 000 3.200% General Mills Inc 10/02/2027                             | 192 328          | 0,01              |
| 200 000 2.875% General Mills Inc 15/04/2030                             | 179 522          | 0,01              |
| 50 000 4.700% General Mills Inc 17/04/2048                              | 47 879           | 0,00              |
| 100 000 6.125% General Motors Co 01/10/2025                             | 101 748          | 0,01              |
| 50 000 5.600% General Motors Co 15/10/2032                              | 48 837           | 0,00              |
| 50 000 6.600% General Motors Co 01/04/2036                              | 51 533           | 0,00              |
| 100 000 5.150% General Motors Co 01/04/2038                             | 90 350           | 0,00              |
| 100 000 5.200% General Motors Co 01/04/2045                             | 83 889           | 0,00              |
| 100 000 6.750% General Motors Co 01/04/2046                             | 101 378          | 0,01              |
| 200 000 5.400% General Motors Co 01/04/2048                             | 172 824          | 0,01              |
| 50 000 5.950% General Motors Co 01/04/2049                              | 46 879           | 0,00              |
| 200 000 4.000% General Motors Financial Co Inc 15/01/2025               | 194 996          | 0,01              |
| 100 000 3.800% General Motors Financial Co Inc 07/04/2025               | 97 180           | 0,00              |
| 100 000 4.350% General Motors Financial Co Inc 09/04/2025               | 97 964           | 0,00              |
| 100 000 2.750% General Motors Financial Co Inc 20/06/2025               | 94 763           | 0,00              |
| 200 000 6.050% General Motors Financial Co Inc 10/10/2025               | 203 330          | 0,01              |
| 100 000 5.000% General Motors Financial Co Inc 09/04/2027               | 98 898           | 0,01              |
| 50 000 6.000% General Motors Financial Co Inc 09/01/2028                | 51 166           | 0,00              |
| 100 000 2.400% General Motors Financial Co Inc 15/10/2028               | 85 671           | 0,00              |
| 100 000 4.300% General Motors Financial Co Inc 06/04/2029               | 93 172           | 0,00              |
| 100 000 2.350% General Motors Financial Co Inc 08/01/2031               | 78 987           | 0,00              |
| 200 000 2.700% General Motors Financial Co Inc 10/06/2031               | 160 370          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 150 000 3.100% General Motors Financial Co Inc 12/01/2032               | 122 262          | 0,01              |
| 200 000 3.882% Genm Capital Labuan Ltd 19/04/2031                       | 155 230          | 0,01              |
| 200 000 1.875% Genuine Parts Co 01/11/2030                              | 159 192          | 0,01              |
| 50 000 2.750% Genuine Parts Co 01/02/2032                               | 41 546           | 0,00              |
| 50 000 4.300% George Washington University 15/09/2044                   | 44 650           | 0,00              |
| 50 000 4.126% George Washington University 15/09/2048                   | 44 685           | 0,00              |
| 100 000 4.700% Georgia Power Co 15/05/2032                              | 99 137           | 0,01              |
| 100 000 3.700% Georgia Power Co 30/01/2050                              | 77 592           | 0,00              |
| 100 000 3.250% Georgia Power Co 15/03/2051                              | 71 486           | 0,00              |
| 100 000 3.600% Georgia-Pacific LLC 01/03/2025                           | 97 350           | 0,00              |
| 200 000 0.950% Georgia-Pacific LLC 15/05/2026                           | 177 848          | 0,01              |
| 50 000 2.100% Georgia-Pacific LLC 30/04/2027                            | 45 650           | 0,00              |
| 50 000 2.300% Georgia-Pacific LLC 30/04/2030                            | 43 074           | 0,00              |
| 100 000 3.500% Gilead Sciences Inc 01/02/2025                           | 98 081           | 0,01              |
| 50 000 2.950% Gilead Sciences Inc 01/03/2027                            | 47 602           | 0,00              |
| 100 000 1.200% Gilead Sciences Inc 01/10/2027                           | 87 389           | 0,00              |
| 100 000 4.600% Gilead Sciences Inc 01/09/2035                           | 99 120           | 0,01              |
| 50 000 4.000% Gilead Sciences Inc 01/09/2036                            | 46 299           | 0,00              |
| 100 000 2.600% Gilead Sciences Inc 01/10/2040                           | 73 686           | 0,00              |
| 50 000 5.650% Gilead Sciences Inc 01/12/2041                            | 54 007           | 0,00              |
| 100 000 4.150% Gilead Sciences Inc 01/03/2047                           | 87 845           | 0,00              |
| 50 000 6.375% GlaxoSmithKline Capital Inc 15/05/2038                    | 58 888           | 0,00              |
| 100 000 3.000% GlaxoSmithKline Capital PLC 01/06/2024                   | 98 008           | 0,01              |
| 300 000 3.375% GlaxoSmithKline Capital PLC 01/06/2029                   | 285 000          | 0,01              |
| 100 000 6.900% Glencore Finance Canada Ltd 15/11/2037                   | 111 034          | 0,01              |
| 50 000 1.625% Glencore Funding LLC 01/09/2025                           | 46 206           | 0,00              |
| 25 000 4.000% Glencore Funding LLC 27/03/2027                           | 24 056           | 0,00              |
| 100 000 2.625% Glencore Funding LLC 23/09/2031                          | 82 058           | 0,00              |
| 50 000 4.400% Global Atlantic Fin Co 15/10/2029                         | 44 617           | 0,00              |
| 100 000 1.200% Global Payments Inc 01/03/2026                           | 89 038           | 0,00              |
| 100 000 2.900% Global Payments Inc 15/05/2030                           | 84 733           | 0,00              |
| 50 000 2.900% Global Payments Inc 15/11/2031                            | 40 980           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 5.400% Global Payments Inc 15/08/2032                            | 48 965           | 0,00              | 225 000 4.223% Goldman Sachs Group Inc 01/05/2029                       | 214 726          | 0,01              |
| 50 000 4.150% Global Payments Inc 15/08/2049                            | 37 360           | 0,00              | 200 000 2.600% Goldman Sachs Group Inc 07/02/2030                       | 171 758          | 0,01              |
| 50 000 5.950% Global Payments Inc 15/08/2052                            | 47 742           | 0,00              | 250 000 3.800% Goldman Sachs Group Inc 15/03/2030                       | 232 855          | 0,01              |
| 100 000 4.550% Globe Life Inc 15/09/2028                                | 99 336           | 0,01              | 100 000 1.992% Goldman Sachs Group Inc 27/01/2032                       | 79 759           | 0,00              |
| 100 000 5.750% GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 01/06/2028         | 97 533           | 0,00              | 200 000 2.383% Goldman Sachs Group Inc 21/07/2032                       | 162 700          | 0,01              |
| 100 000 5.300% GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 15/01/2029         | 95 164           | 0,00              | 100 000 2.650% Goldman Sachs Group Inc 21/10/2032                       | 82 467           | 0,00              |
| 50 000 4.000% GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 15/01/2031          | 43 521           | 0,00              | 100 000 3.102% Goldman Sachs Group Inc 24/02/2033                       | 85 706           | 0,00              |
| 200 000 3.250% GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 15/01/2032         | 163 294          | 0,01              | 200 000 6.750% Goldman Sachs Group Inc 01/10/2037                       | 216 880          | 0,01              |
| 200 000 4.250% Gohl Capital Ltd 24/01/2027                              | 184 134          | 0,01              | 100 000 4.017% Goldman Sachs Group Inc 31/10/2038                       | 86 452           | 0,00              |
| 50 000 2.875% Goldman Sachs BDC Inc 15/01/2026                          | 45 394           | 0,00              | 75 000 4.411% Goldman Sachs Group Inc 23/04/2039                        | 67 531           | 0,00              |
| 200 000 5.700% Goldman Sachs Group Inc 01/11/2024                       | 201 508          | 0,01              | 50 000 2.908% Goldman Sachs Group Inc 21/07/2042                        | 35 825           | 0,00              |
| 100 000 3.500% Goldman Sachs Group Inc 23/01/2025                       | 97 310           | 0,00              | 100 000 3.436% Goldman Sachs Group Inc 24/02/2043                       | 77 028           | 0,00              |
| 300 000 3.500% Goldman Sachs Group Inc 01/04/2025                       | 291 318          | 0,01              | 50 000 4.800% Goldman Sachs Group Inc 08/07/2044                        | 46 459           | 0,00              |
| 100 000 3.272% Goldman Sachs Group Inc 29/09/2025                       | 96 970           | 0,00              | 150 000 5.150% Goldman Sachs Group Inc 22/05/2045                       | 142 489          | 0,01              |
| 100 000 0.855% Goldman Sachs Group Inc 12/02/2026                       | 91 489           | 0,00              | 50 000 2.050% Golub Capital BDC Inc 15/02/2027                          | 40 923           | 0,00              |
| 150 000 3.750% Goldman Sachs Group Inc 25/02/2026                       | 145 902          | 0,01              | 150 000 3.700% Goodman US Finance Three LLC 15/03/2028                  | 138 568          | 0,01              |
| 100 000 3.500% Goldman Sachs Group Inc 16/11/2026                       | 95 514           | 0,00              | 50 000 4.150% Great-West Lifeco Finance Delaware LP 03/06/2047          | 39 381           | 0,00              |
| 50 000 3.850% Goldman Sachs Group Inc 26/01/2027                        | 48 274           | 0,00              | 200 000 0.904% Great-West Lifeco US Finance 2020 LP 12/08/2025          | 181 272          | 0,01              |
| 150 000 1.431% Goldman Sachs Group Inc 09/03/2027                       | 134 079          | 0,01              | 50 000 6.625% Grupo Televisa SAB 15/01/2040                             | 53 091           | 0,00              |
| 200 000 1.542% Goldman Sachs Group Inc 10/09/2027                       | 176 042          | 0,01              | 50 000 5.000% Grupo Televisa SAB 13/05/2045                             | 44 759           | 0,00              |
| 100 000 1.948% Goldman Sachs Group Inc 21/10/2027                       | 89 303           | 0,00              | 140 000 3.396% GS Mortgage Securities Trust 2015-GC28 10/02/2048        | 134 973          | 0,01              |
| 50 000 2.640% Goldman Sachs Group Inc 24/02/2028                        | 45 650           | 0,00              | 250 000 3.674% GS Mortgage Securities Trust 2017-GS5 10/03/2050         | 234 563          | 0,01              |
| 100 000 3.615% Goldman Sachs Group Inc 15/03/2028                       | 94 690           | 0,00              | 100 000 3.638% GS Mortgage Securities Trust 2017-GS6 10/05/2050         | 91 493           | 0,00              |
| 50 000 3.691% Goldman Sachs Group Inc 05/06/2028                        | 47 445           | 0,00              | 55 000 3.469% GS Mortgage Securities Trust 2017-GS8 10/11/2050          | 50 976           | 0,00              |
| 100 000 4.482% Goldman Sachs Group Inc 23/08/2028                       | 97 832           | 0,00              | 250 000 3.375% GSK Consumer Healthcare Capital US LLC 24/03/2029        | 230 390          | 0,01              |
| 200 000 3.814% Goldman Sachs Group Inc 23/04/2029                       | 188 134          | 0,01              | 100 000 4.875% Guardian Life Insurance Co of America 19/06/2064         | 88 981           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>           |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>     |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                                   |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 3.700% Guardian Life Insurance Co of America 22/01/2070              | 34 749           | 0,00              | 50 000 2.300% Hershey Co 15/08/2026                                     | 47 499           | 0,00              |
| 50 000 4.850% Guardian Life Insurance Co of America 24/01/2077              | 43 461           | 0,00              | 100 000 5.600% Hess Corp 15/02/2041                                     | 96 474           | 0,00              |
| 200 000 2.375% Gulf International Bank BSC 23/09/2025                       | 184 062          | 0,01              | 100 000 1.450% Hewlett Packard Enterprise Co 01/04/2024                 | 96 196           | 0,00              |
| 150 000 4.600% Gulfstream Natural Gas System LLC 15/09/2025                 | 146 565          | 0,01              | 200 000 4.900% Hewlett Packard Enterprise Co 15/10/2025                 | 199 478          | 0,01              |
| 200 000 4.250% GUSAP III LP 21/01/2030                                      | 184 610          | 0,01              | 50 000 1.750% Hewlett Packard Enterprise Co 01/04/2026                  | 46 032           | 0,00              |
| 200 000 2.675% Hackensack Meridian Health Inc 01/09/2041                    | 142 776          | 0,01              | 50 000 6.350% Hewlett Packard Enterprise Co 15/10/2045                  | 52 584           | 0,00              |
| 100 000 2.920% Halliburton Co 01/03/2030                                    | 89 151           | 0,00              | 50 000 5.875% HF Sinclair Corp 01/04/2026                               | 50 557           | 0,00              |
| 50 000 4.850% Halliburton Co 15/11/2035                                     | 48 054           | 0,00              | 200 000 4.111% High Street Funding Trust I 15/02/2028                   | 190 980          | 0,01              |
| 50 000 4.750% Halliburton Co 01/08/2043                                     | 44 039           | 0,00              | 100 000 4.682% High Street Funding Trust II 15/02/2048                  | 80 691           | 0,00              |
| 200 000 5.000% Halliburton Co 15/11/2045                                    | 182 130          | 0,01              | 50 000 3.875% Highwoods Realty LP 01/03/2027                            | 45 363           | 0,00              |
| 200 000 3.379% Hanwha Life Insurance Co Ltd 04/02/2032                      | 176 804          | 0,01              | 150 000 3.050% Highwoods Realty LP 15/02/2030                           | 118 366          | 0,01              |
| 100 000 3.500% Harley-Davidson Inc 28/07/2025                               | 95 460           | 0,00              | 200 000 3.625% HKT Capital No 2 Ltd 02/04/2025                          | 194 768          | 0,01              |
| 50 000 3.600% Hartford Financial Services Group Inc 19/08/2049              | 37 985           | 0,00              | 200 000 4.750% Holcim Finance US LLC 22/09/2046                         | 169 990          | 0,01              |
| 100 000 3.900% Hasbro Inc 19/11/2029  | 91 069           | 0,00              | 150 000 3.350% Home Depot Inc 15/09/2025                                | 146 890          | 0,01              |
| 50 000 5.100% Hasbro Inc 15/05/2044   | 43 750           | 0,00              | 100 000 3.000% Home Depot Inc 01/04/2026                                | 97 005           | 0,00              |
| 150 000 5.375% HCA Inc 01/02/2025   | 150 049          | 0,01              | 50 000 2.125% Home Depot Inc 15/09/2026                                 | 46 910           | 0,00              |
| 50 000 5.250% HCA Inc 15/04/2025  | 50 148           | 0,00              | 100 000 2.500% Home Depot Inc 15/04/2027                                | 93 862           | 0,00              |
| 250 000 5.875% HCA Inc 15/02/2026   | 253 647          | 0,01              | 50 000 2.875% Home Depot Inc 15/04/2027                                 | 47 660           | 0,00              |
| 100 000 5.375% HCA Inc 01/09/2026   | 100 340          | 0,01              | 250 000 2.800% Home Depot Inc 14/09/2027                                | 236 912          | 0,01              |
| 100 000 3.125% HCA Inc 15/03/2027   | 92 977           | 0,00              | 50 000 0.900% Home Depot Inc 15/03/2028                                 | 42 642           | 0,00              |
| 50 000 4.125% HCA Inc 15/06/2029  | 46 955           | 0,00              | 100 000 3.900% Home Depot Inc 06/12/2028                                | 98 498           | 0,01              |
| 50 000 3.500% HCA Inc 01/09/2030  | 44 542           | 0,00              | 100 000 5.875% Home Depot Inc 16/12/2036                                | 111 585          | 0,01              |
| 150 000 3.625% HCA Inc 15/03/2032   | 131 928          | 0,01              | 100 000 3.300% Home Depot Inc 15/04/2040                                | 83 234           | 0,00              |
| 100 000 5.125% HCA Inc 15/06/2039   | 93 298           | 0,00              | 50 000 5.400% Home Depot Inc 15/09/2040                                 | 52 554           | 0,00              |
| 50 000 5.500% HCA Inc 15/06/2047  | 46 927           | 0,00              | 50 000 5.950% Home Depot Inc 01/04/2041                                 | 56 058           | 0,00              |
| 100 000 5.250% HCA Inc 15/06/2049   | 90 236           | 0,00              | 150 000 3.125% Home Depot Inc 15/12/2049                                | 111 120          | 0,01              |
| 150 000 3.500% HCA Inc 15/07/2051   | 103 608          | 0,01              | 100 000 3.350% Home Depot Inc 15/04/2050                                | 77 533           | 0,00              |
| 100 000 4.625% HCA Inc 15/03/2052   | 83 082           | 0,00              | 200 000 2.375% Home Depot Inc 15/03/2051                                | 126 122          | 0,01              |
| 50 000 3.200% Health Care Service Corp A Mutual Legal Reserve Co 01/06/2050 | 36 286           | 0,00              | 100 000 3.625% Home Depot Inc 15/04/2052                                | 80 509           | 0,00              |
| 50 000 3.750% Healthcare Realty Holdings LP 01/07/2027                      | 46 895           | 0,00              | 100 000 4.950% Home Depot Inc 15/09/2052                                | 99 951           | 0,01              |
| 50 000 3.100% Healthcare Realty Holdings LP 15/02/2030                      | 43 403           | 0,00              | 100 000 3.500% Home Depot Inc 15/09/2056                                | 77 948           | 0,00              |
| 100 000 3.500% Healthpeak Properties Interim Inc 15/07/2029                 | 91 356           | 0,00              | 100 000 2.271% Honda Motor Co Ltd 10/03/2025                            | 95 710           | 0,00              |
| 100 000 2.875% Healthpeak Properties Interim Inc 15/01/2031                 | 86 069           | 0,00              | 100 000 2.534% Honda Motor Co Ltd 10/03/2027                            | 93 787           | 0,00              |
| 100 000 3.500% Heineken NV 29/01/2028                                       | 96 079           | 0,00              | 50 000 2.300% Honeywell International Inc 15/08/2024                    | 48 562           | 0,00              |
| 100 000 4.000% Heineken NV 01/10/2042                                       | 85 407           | 0,00              | 100 000 1.350% Honeywell International Inc 01/06/2025                   | 94 275           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 250 000 2.500% Honeywell International Inc 01/11/2026                   | 237 377          | 0,01              |
| 100 000 2.700% Honeywell International Inc 15/08/2029                   | 92 157           | 0,00              |
| 50 000 1.950% Honeywell International Inc 01/06/2030                    | 42 761           | 0,00              |
| 200 000 2.250% Hongkong Land Finance Cayman Islands Co Ltd 15/07/2031   | 166 516          | 0,01              |
| 50 000 1.800% Hormel Foods Corp 11/06/2030                              | 41 795           | 0,00              |
| 100 000 3.375% Host Hotels & Resorts LP 15/12/2029                      | 84 845           | 0,00              |
| 50 000 2.900% Host Hotels & Resorts LP 15/12/2031                       | 39 039           | 0,00              |
| 50 000 2.200% HP Inc 17/06/2025   | 47 158           | 0,00              |
| 50 000 1.450% HP Inc 17/06/2026   | 44 998           | 0,00              |
| 100 000 4.750% HP Inc 15/01/2028  | 98 863           | 0,01              |
| 200 000 4.200% HP Inc 15/04/2032  | 180 108          | 0,01              |
| 100 000 5.500% HP Inc 15/01/2033  | 99 081           | 0,01              |
| 50 000 6.000% HP Inc 15/09/2041   | 51 204           | 0,00              |
| 200 000 1.500% HPHT Finance 21 II Ltd 17/09/2026                        | 179 102          | 0,01              |
| 200 000 0.950% HSBC Bank Canada 14/05/2023                              | 199 072          | 0,01              |
| 200 000 2.099% HSBC Holdings PLC 04/06/2026                             | 183 776          | 0,01              |
| 200 000 4.292% HSBC Holdings PLC 12/09/2026                             | 191 380          | 0,01              |
| 200 000 7.336% HSBC Holdings PLC 03/11/2026                             | 208 108          | 0,01              |
| 200 000 4.375% HSBC Holdings PLC 23/11/2026                             | 191 066          | 0,01              |
| 200 000 4.755% HSBC Holdings PLC 09/06/2028                             | 193 668          | 0,01              |
| 200 000 5.210% HSBC Holdings PLC 11/08/2028                             | 198 336          | 0,01              |
| 200 000 7.390% HSBC Holdings PLC 03/11/2028                             | 213 774          | 0,01              |
| 200 000 4.583% HSBC Holdings PLC 19/06/2029                             | 190 232          | 0,01              |
| 200 000 3.973% HSBC Holdings PLC 22/05/2030                             | 180 748          | 0,01              |
| 200 000 2.848% HSBC Holdings PLC 04/06/2031                             | 168 054          | 0,01              |
| 200 000 2.357% HSBC Holdings PLC 18/08/2031                             | 161 360          | 0,01              |
| 200 000 2.804% HSBC Holdings PLC 24/05/2032                             | 163 436          | 0,01              |
| 200 000 5.402% HSBC Holdings PLC 11/08/2033                             | 197 678          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 200 000 8.113% HSBC Holdings PLC 03/11/2033                             | 223 344          | 0,01              |
| 100 000 6.500% HSBC Holdings PLC 02/05/2036                             | 101 137          | 0,01              |
| 100 000 6.800% HSBC Holdings PLC 01/06/2038                             | 102 144          | 0,01              |
| 50 000 6.100% HSBC Holdings PLC 14/01/2042                              | 53 528           | 0,00              |
| 100 000 3.500% HSBC USA Inc 23/06/2024                                  | 97 156           | 0,00              |
| 200 000 3.375% Huarong Finance 2019 Co Ltd 24/02/2030                   | 135 642          | 0,01              |
| 200 000 4.625% Huarong Finance II Co Ltd 03/06/2026                     | 167 990          | 0,01              |
| 50 000 3.950% Hudson Pacific Properties LP 01/11/2027                   | 34 397           | 0,00              |
| 100 000 3.250% Hudson Pacific Properties LP 15/01/2030                  | 64 110           | 0,00              |
| 50 000 3.850% Humana Inc 01/10/2024                                     | 49 156           | 0,00              |
| 50 000 1.350% Humana Inc 03/02/2027                                     | 43 946           | 0,00              |
| 100 000 4.875% Humana Inc 01/04/2030                                    | 100 606          | 0,01              |
| 100 000 2.150% Humana Inc 03/02/2032                                    | 80 897           | 0,00              |
| 250 000 5.699% Huntington National Bank 18/11/2025                      | 241 945          | 0,01              |
| 50 000 4.500% Huntsman International LLC 01/05/2029                     | 46 965           | 0,00              |
| 100 000 2.950% Huntsman International LLC 15/06/2031                    | 82 040           | 0,00              |
| 250 000 3.750% Hutama Karya Persero PT 11/05/2030                       | 227 832          | 0,01              |
| 50 000 5.375% Hyatt Hotels Corp 23/04/2025                              | 49 732           | 0,00              |
| 100 000 5.750% Hyatt Hotels Corp 23/04/2030                             | 101 500          | 0,01              |
| 200 000 2.820% Hysan MTN Ltd 04/09/2029                                 | 178 114          | 0,01              |
| 50 000 1.000% Hyundai Capital America 17/09/2024                        | 46 879           | 0,00              |
| 50 000 1.800% Hyundai Capital America 15/10/2025                        | 45 896           | 0,00              |
| 200 000 1.300% Hyundai Capital America 08/01/2026                       | 179 620          | 0,01              |
| 50 000 1.500% Hyundai Capital America 15/06/2026                        | 44 489           | 0,00              |
| 50 000 1.650% Hyundai Capital America 17/09/2026                        | 44 300           | 0,00              |
| 50 000 2.750% Hyundai Capital America 27/09/2026                        | 45 939           | 0,00              |
| 50 000 3.500% Hyundai Capital America 02/11/2026                        | 47 044           | 0,00              |
| 150 000 1.800% Hyundai Capital America 10/01/2028                       | 127 489          | 0,01              |
| 50 000 5.810% Iberdrola International BV 15/03/2025                     | 51 129           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>            |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>      |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                                    |                  |                   |
| 50 000 6.750% Iberdrola International BV<br>15/07/2036                       | 56 947           | 0,00              |
| 200 000 1.625% ICBCIL Finance Co Ltd<br>02/11/2024                           | 189 800          | 0,01              |
| 200 000 2.843% IDB Trust Services Ltd<br>25/04/2024                          | 195 880          | 0,01              |
| 50 000 3.900% Illinois Tool Works Inc<br>01/09/2042                          | 45 122           | 0,00              |
| 50 000 2.550% Illumina Inc 23/03/2031  | 41 336           | 0,00              |
| 200 000 3.125% Imperial Brands Finance PLC<br>26/07/2024                     | 193 696          | 0,01              |
| 200 000 4.250% Imperial Brands Finance PLC<br>21/07/2025                     | 193 724          | 0,01              |
| 100 000 3.750% Indiana Michigan Power Co<br>01/07/2047                       | 77 916           | 0,00              |
| 50 000 4.050% Indianapolis Power & Light Co<br>01/05/2046                    | 41 596           | 0,00              |
| 200 000 3.398% Indofood CBP Sukses Makmur<br>Tbk PT 09/06/2031               | 166 582          | 0,01              |
| 200 000 4.875% Industrial & Commercial Bank of<br>China Ltd 21/09/2025       | 198 610          | 0,01              |
| 200 000 2.875% Industrial & Commercial Bank of<br>China Macau Ltd 12/09/2029 | 192 792          | 0,01              |
| 100 000 1.750% Infor Inc 15/07/2025  | 91 171           | 0,00              |
| 200 000 4.625% ING Groep NV 06/01/2026                                       | 196 834          | 0,01              |
| 200 000 3.869% ING Groep NV 28/03/2026                                       | 193 464          | 0,01              |
| 200 000 1.400% ING Groep NV 01/07/2026                                       | 182 994          | 0,01              |
| 200 000 1.726% ING Groep NV 01/04/2027                                       | 178 036          | 0,01              |
| 200 000 4.050% ING Groep NV 09/04/2029                                       | 187 674          | 0,01              |
| 200 000 2.900% Ingredion Inc 01/06/2030                                      | 175 702          | 0,01              |
| 50 000 5.459% Intact Financial Corp<br>22/09/2032                            | 50 298           | 0,00              |
| 100 000 3.400% Intel Corp 25/03/2025   | 98 278           | 0,01              |
| 50 000 3.700% Intel Corp 29/07/2025  | 49 285           | 0,00              |
| 200 000 3.750% Intel Corp 25/03/2027   | 196 368          | 0,01              |
| 100 000 3.750% Intel Corp 05/08/2027   | 97 711           | 0,00              |
| 100 000 1.600% Intel Corp 12/08/2028   | 87 296           | 0,00              |
| 100 000 4.000% Intel Corp 05/08/2029   | 97 352           | 0,00              |
| 100 000 2.450% Intel Corp 15/11/2029   | 88 054           | 0,00              |
| 100 000 2.000% Intel Corp 12/08/2031   | 82 283           | 0,00              |
| 100 000 4.150% Intel Corp 05/08/2032   | 96 458           | 0,00              |
| 50 000 5.200% Intel Corp 10/02/2033  | 50 849           | 0,00              |
| 50 000 4.600% Intel Corp 25/03/2040  | 46 950           | 0,00              |
| 50 000 2.800% Intel Corp 12/08/2041  | 36 346           | 0,00              |
| 50 000 5.625% Intel Corp 10/02/2043  | 51 219           | 0,00              |
| 75 000 4.100% Intel Corp 19/05/2046  | 63 869           | 0,00              |
| 100 000 3.734% Intel Corp 08/12/2047   | 79 418           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 3.250% Intel Corp 15/11/2049                                    | 71 194           | 0,00              |
| 100 000 4.750% Intel Corp 25/03/2050                                    | 91 526           | 0,00              |
| 50 000 3.050% Intel Corp 12/08/2051                                     | 34 166           | 0,00              |
| 100 000 4.900% Intel Corp 05/08/2052                                    | 93 121           | 0,00              |
| 50 000 5.700% Intel Corp 10/02/2053                                     | 50 939           | 0,00              |
| 50 000 3.100% Intel Corp 15/02/2060                                     | 32 888           | 0,00              |
| 100 000 4.950% Intel Corp 25/03/2060                                    | 92 789           | 0,00              |
| 50 000 3.200% Intel Corp 12/08/2061                                     | 33 046           | 0,00              |
| 50 000 5.900% Intel Corp 10/02/2063                                     | 51 414           | 0,00              |
| 300 000 3.250% Inter-American Development<br>Bank 01/07/2024            | 295 611          | 0,01              |
| 250 000 2.125% Inter-American Development<br>Bank 15/01/2025            | 241 182          | 0,01              |
| 200 000 1.750% Inter-American Development<br>Bank 14/03/2025            | 191 094          | 0,01              |
| 113 000 7.000% Inter-American Development<br>Bank 15/06/2025            | 119 578          | 0,01              |
| 200 000 0.625% Inter-American Development<br>Bank 15/07/2025            | 185 320          | 0,01              |
| 250 000 0.875% Inter-American Development<br>Bank 20/04/2026            | 228 550          | 0,01              |
| 100 000 2.000% Inter-American Development<br>Bank 02/06/2026            | 94 299           | 0,00              |
| 100 000 2.000% Inter-American Development<br>Bank 23/07/2026            | 94 188           | 0,00              |
| 268 000 3.125% Inter-American Development<br>Bank 18/09/2028            | 259 973          | 0,01              |
| 50 000 2.250% Inter-American Development<br>Bank 18/06/2029             | 45 939           | 0,00              |
| 200 000 3.500% Inter-American Development<br>Bank 14/09/2029            | 197 448          | 0,01              |
| 50 000 3.875% Inter-American Development<br>Bank 28/10/2041             | 48 395           | 0,00              |
| 100 000 1.750% Inter-American Investment Corp<br>02/10/2024             | 96 053           | 0,00              |
| 200 000 0.625% Inter-American Investment Corp<br>10/02/2026             | 180 994          | 0,01              |
| 100 000 3.650% Intercontinental Exchange Inc<br>23/05/2025              | 98 383           | 0,01              |
| 50 000 3.750% Intercontinental Exchange Inc<br>01/12/2025               | 48 650           | 0,00              |
| 100 000 2.100% Intercontinental Exchange Inc<br>15/06/2030              | 84 672           | 0,00              |
| 50 000 1.850% Intercontinental Exchange Inc<br>15/09/2032               | 39 407           | 0,00              |
| 100 000 4.600% Intercontinental Exchange Inc<br>15/03/2033              | 99 182           | 0,01              |
| 50 000 2.650% Intercontinental Exchange Inc<br>15/09/2040               | 36 277           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>             |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 50 000 4.250% Intercontinental Exchange Inc 21/09/2048                        | 43 672           | 0,00              |
| 100 000 3.000% Intercontinental Exchange Inc 15/06/2050                       | 70 617           | 0,00              |
| 100 000 4.950% Intercontinental Exchange Inc 15/06/2052                       | 97 364           | 0,00              |
| 50 000 3.000% Intercontinental Exchange Inc 15/09/2060                        | 32 748           | 0,00              |
| 350 000 1.500% International Bank for Reconstruction & Development 28/08/2024 | 336 420          | 0,01              |
| 50 000 2.500% International Bank for Reconstruction & Development 25/11/2024  | 48 615           | 0,00              |
| 300 000 1.625% International Bank for Reconstruction & Development 15/01/2025 | 287 004          | 0,01              |
| 250 000 0.750% International Bank for Reconstruction & Development 11/03/2025 | 234 422          | 0,01              |
| 150 000 0.625% International Bank for Reconstruction & Development 22/04/2025 | 139 806          | 0,01              |
| 250 000 0.375% International Bank for Reconstruction & Development 28/07/2025 | 230 050          | 0,01              |
| 350 000 2.500% International Bank for Reconstruction & Development 29/07/2025 | 338 495          | 0,01              |
| 300 000 0.500% International Bank for Reconstruction & Development 28/10/2025 | 274 920          | 0,01              |
| 100 000 0.875% International Bank for Reconstruction & Development 15/07/2026 | 90 965           | 0,00              |
| 200 000 3.125% International Bank for Reconstruction & Development 15/06/2027 | 195 430          | 0,01              |
| 200 000 0.750% International Bank for Reconstruction & Development 24/11/2027 | 174 728          | 0,01              |
| 200 000 1.375% International Bank for Reconstruction & Development 20/04/2028 | 178 684          | 0,01              |
| 250 000 1.125% International Bank for Reconstruction & Development 13/09/2028 | 218 167          | 0,01              |
| 200 000 3.625% International Bank for Reconstruction & Development 21/09/2029 | 198 998          | 0,01              |
| 300 000 0.875% International Bank for Reconstruction & Development 14/05/2030 | 247 281          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>             |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 200 000 1.250% International Bank for Reconstruction & Development 10/02/2031 | 167 708          | 0,01              |
| 200 000 1.625% International Bank for Reconstruction & Development 03/11/2031 | 170 582          | 0,01              |
| 200 000 2.500% International Bank for Reconstruction & Development 29/03/2032 | 182 628          | 0,01              |
| 100 000 3.000% International Business Machines Corp 15/05/2024                | 98 157           | 0,01              |
| 100 000 4.000% International Business Machines Corp 27/07/2025                | 98 869           | 0,01              |
| 100 000 3.450% International Business Machines Corp 19/02/2026                | 97 107           | 0,00              |
| 200 000 3.300% International Business Machines Corp 15/05/2026                | 192 832          | 0,01              |
| 100 000 3.300% International Business Machines Corp 27/01/2027                | 95 816           | 0,00              |
| 200 000 1.700% International Business Machines Corp 15/05/2027                | 179 210          | 0,01              |
| 150 000 4.150% International Business Machines Corp 15/05/2029                | 132 906          | 0,01              |
| 100 000 2.850% International Business Machines Corp 15/05/2040                | 73 556           | 0,00              |
| 50 000 4.000% International Business Machines Corp 20/06/2042                 | 42 650           | 0,00              |
| 200 000 4.250% International Business Machines Corp 15/05/2049                | 171 322          | 0,01              |
| 100 000 2.950% International Business Machines Corp 15/05/2050                | 67 677           | 0,00              |
| 200 000 0.875% International Development Association 28/04/2026               | 182 058          | 0,01              |
| 50 000 1.000% International Development Association 03/12/2030                | 40 937           | 0,00              |
| 250 000 1.375% International Finance Corp 16/10/2024                          | 239 217          | 0,01              |
| 200 000 0.375% International Finance Corp 16/07/2025                          | 184 386          | 0,01              |
| 100 000 0.750% International Finance Corp 08/10/2026                          | 89 966           | 0,00              |
| 100 000 1.832% International Flavors & Fragrances Inc 15/10/2027              | 84 760           | 0,00              |
| 200 000 2.300% International Flavors & Fragrances Inc 01/11/2030              | 160 630          | 0,01              |
| 200 000 5.000% International Flavors & Fragrances Inc 26/09/2048              | 170 684          | 0,01              |
| 50 000 3.468% International Flavors & Fragrances Inc 01/12/2050               | 33 999           | 0,00              |
| 50 000 4.800% International Paper Co 15/06/2044                               | 45 815           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                      |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                      |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>                |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>                |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>  |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 80 000 4.350% International Paper Co<br>15/08/2048                                     | 69 402           | 0,00              | 150 000 5.750% JBS USA LUX SA / JBS USA<br>Food Co / JBS USA Finance Inc<br>01/04/2033 | 144 076          | 0,01              |
| 50 000 3.375% Interpublic Group of Cos Inc<br>01/03/2041                               | 37 453           | 0,00              | 100 000 4.150% Jefferies Financial Group Inc<br>23/01/2030                             | 91 549           | 0,00              |
| 50 000 4.100% Interstate Power and Light Co<br>26/09/2028                              | 49 002           | 0,00              | 150 000 2.625% Jefferies Financial Group Inc<br>15/10/2031                             | 116 053          | 0,01              |
| 100 000 2.300% Interstate Power and Light Co<br>01/06/2030                             | 83 938           | 0,00              | 43 294 2.750% JetBlue 2019-1 Class AA Pass<br>Through Trust 15/11/2033                 | 36 366           | 0,00              |
| 200 000 3.875% Intesa Sanpaolo SpA<br>12/01/2028                                       | 178 698          | 0,01              | 200 000 2.500% JMH Co Ltd 09/04/2031   | 170 540          | 0,01              |
| 200 000 8.248% Intesa Sanpaolo SpA<br>21/11/2033                                       | 211 428          | 0,01              | 50 000 2.650% John Deere Capital Corp<br>24/06/2024                                    | 48 794           | 0,00              |
| 100 000 1.350% Intuit Inc 15/07/2027   | 88 890           | 0,00              | 150 000 2.050% John Deere Capital Corp<br>09/01/2025                                   | 144 624          | 0,01              |
| 200 000 1.650% Inventive Global Investments Ltd<br>03/09/2025                          | 184 464          | 0,01              | 50 000 1.250% John Deere Capital Corp<br>10/01/2025                                    | 47 376           | 0,00              |
| 50 000 2.300% Invitation Homes Operating<br>Partnership LP 15/11/2028                  | 41 837           | 0,00              | 100 000 3.450% John Deere Capital Corp<br>13/03/2025                                   | 98 384           | 0,01              |
| 200 000 2.000% Invitation Homes Operating<br>Partnership LP 15/08/2031                 | 153 584          | 0,01              | 100 000 3.400% John Deere Capital Corp<br>06/06/2025                                   | 97 935           | 0,00              |
| 50 000 2.700% Invitation Homes Operating<br>Partnership LP 15/01/2034                  | 38 383           | 0,00              | 100 000 2.650% John Deere Capital Corp<br>10/06/2026                                   | 95 034           | 0,00              |
| 200 000 3.375% IOI Investment L Bhd<br>02/11/2031                                      | 157 108          | 0,01              | 75 000 2.800% John Deere Capital Corp<br>08/09/2027                                    | 70 516           | 0,00              |
| 100 000 3.665% Iowa Health System 15/02/2050   | 76 994           | 0,00              | 100 000 4.150% John Deere Capital Corp<br>15/09/2027                                   | 99 479           | 0,01              |
| 200 000 1.262% Isdb Trust Services NO 2 SARL<br>31/03/2026                             | 183 492          | 0,01              | 50 000 2.800% John Deere Capital Corp<br>18/07/2029                                    | 45 699           | 0,00              |
| 200 000 4.747% Isdb Trust Services NO 2 SARL<br>27/10/2027                             | 205 328          | 0,01              | 100 000 2.450% John Deere Capital Corp<br>09/01/2030                                   | 88 966           | 0,00              |
| 200 000 5.000% Israel Electric Corp Ltd<br>12/11/2024                                  | 197 718          | 0,01              | 50 000 3.900% John Deere Capital Corp<br>07/06/2032                                    | 48 150           | 0,00              |
| 100 000 3.650% ITC Holdings Corp 15/06/2024  | 98 017           | 0,01              | 100 000 4.350% John Deere Capital Corp<br>15/09/2032                                   | 99 868           | 0,01              |
| 50 000 2.950% ITC Holdings Corp 14/05/2030   | 44 054           | 0,00              | 50 000 2.625% Johnson & Johnson 15/01/2025   | 48 841           | 0,00              |
| 100 000 3.500% J M Smucker Co 15/03/2025   | 97 599           | 0,00              | 100 000 0.550% Johnson & Johnson 01/09/2025  | 91 864           | 0,00              |
| 50 000 2.375% J M Smucker Co 15/03/2030  | 43 099           | 0,00              | 50 000 0.950% Johnson & Johnson 01/09/2027   | 44 294           | 0,00              |
| 100 000 4.250% J M Smucker Co 15/03/2035   | 93 912           | 0,00              | 50 000 2.900% Johnson & Johnson 15/01/2028   | 47 934           | 0,00              |
| 150 000 1.750% Jackson National Life Global<br>Funding 12/01/2025                      | 141 406          | 0,01              | 150 000 4.375% Johnson & Johnson 05/12/2033  | 154 366          | 0,01              |
| 50 000 3.875% Jackson National Life Global<br>Funding 11/06/2025                       | 48 086           | 0,00              | 50 000 3.400% Johnson & Johnson 15/01/2038   | 45 012           | 0,00              |
| 123 000 3.875% JB Hunt Transport Services Inc<br>01/03/2026                            | 120 743          | 0,01              | 100 000 5.850% Johnson & Johnson 15/07/2038  | 115 595          | 0,01              |
| 50 000 3.000% JBS USA LUX SA / JBS USA<br>Food Co / JBS USA Finance Inc<br>02/02/2029  | 42 836           | 0,00              | 100 000 4.500% Johnson & Johnson 01/09/2040  | 99 669           | 0,01              |
| 100 000 5.500% JBS USA LUX SA / JBS USA<br>Food Co / JBS USA Finance Inc<br>15/01/2030 | 95 515           | 0,00              | 50 000 4.500% Johnson & Johnson 05/12/2043   | 50 357           | 0,00              |
| 100 000 3.750% JBS USA LUX SA / JBS USA<br>Food Co / JBS USA Finance Inc<br>01/12/2031 | 82 598           | 0,00              | 100 000 3.700% Johnson & Johnson 01/03/2046  | 89 568           | 0,00              |
|  |                  |                   | 50 000 3.750% Johnson & Johnson 03/03/2047   | 44 791           | 0,00              |
|  |                  |                   | 50 000 2.250% Johnson & Johnson 01/09/2050   | 33 602           | 0,00              |
|  |                  |                   | 100 000 4.500% Johnson Controls International<br>plc 15/02/2047                        | 87 993           | 0,00              |



## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                      |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>                |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>  |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 55 000 3.914% JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1 15/01/2049 | 52 774           | 0,00              | 50 000 8.000% JPMorgan Chase & Co 29/04/2027                            | 56 671           | 0,00              |
| 201 298 3.670% JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23 15/09/2047          | 194 979          | 0,01              | 100 000 1.470% JPMorgan Chase & Co 22/09/2027                           | 88 392           | 0,00              |
| 65 110 3.801% JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C31 15/08/2048           | 62 620           | 0,00              | 50 000 4.250% JPMorgan Chase & Co 01/10/2027                            | 49 052           | 0,00              |
| 45 000 3.576% JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2016-C1 17/03/2049            | 42 775           | 0,00              | 50 000 3.625% JPMorgan Chase & Co 01/12/2027                            | 47 828           | 0,00              |
| 323 000 3.723% JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2017-JP5 15/03/2050          | 300 978          | 0,01              | 100 000 3.782% JPMorgan Chase & Co 01/02/2028                           | 95 704           | 0,00              |
| 50 000 3.454% JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2017-JP7 15/09/2050           | 46 256           | 0,00              | 100 000 4.323% JPMorgan Chase & Co 26/04/2028                           | 97 683           | 0,00              |
| 125 000 3.694% JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2017-C5 15/03/2050           | 117 334          | 0,01              | 250 000 3.540% JPMorgan Chase & Co 01/05/2028                           | 236 522          | 0,01              |
| 200 000 3.625% JPMorgan Chase & Co 13/05/2024  | 197 448          | 0,01              | 200 000 2.182% JPMorgan Chase & Co 01/06/2028                           | 179 290          | 0,01              |
| 50 000 3.875% JPMorgan Chase & Co 10/09/2024   | 49 151           | 0,00              | 100 000 4.851% JPMorgan Chase & Co 25/07/2028                           | 99 839           | 0,01              |
| 100 000 3.125% JPMorgan Chase & Co 23/01/2025  | 97 227           | 0,00              | 150 000 3.509% JPMorgan Chase & Co 23/01/2029                           | 140 484          | 0,01              |
| 100 000 0.824% JPMorgan Chase & Co 01/06/2025  | 94 750           | 0,00              | 100 000 4.005% JPMorgan Chase & Co 23/04/2029                           | 95 559           | 0,00              |
| 100 000 3.845% JPMorgan Chase & Co 14/06/2025  | 98 265           | 0,01              | 100 000 2.069% JPMorgan Chase & Co 01/06/2029                           | 86 601           | 0,00              |
| 200 000 0.969% JPMorgan Chase & Co 23/06/2025  | 189 454          | 0,01              | 100 000 4.203% JPMorgan Chase & Co 23/07/2029                           | 96 573           | 0,00              |
| 200 000 0.768% JPMorgan Chase & Co 09/08/2025  | 187 632          | 0,01              | 150 000 4.452% JPMorgan Chase & Co 05/12/2029                           | 145 716          | 0,01              |
| 200 000 2.301% JPMorgan Chase & Co 15/10/2025  | 191 204          | 0,01              | 100 000 3.702% JPMorgan Chase & Co 06/05/2030                           | 93 039           | 0,00              |
| 200 000 1.561% JPMorgan Chase & Co 10/12/2025  | 187 434          | 0,01              | 100 000 4.565% JPMorgan Chase & Co 14/06/2030                           | 97 339           | 0,00              |
| 50 000 5.546% JPMorgan Chase & Co 15/12/2025   | 50 332           | 0,00              | 200 000 2.739% JPMorgan Chase & Co 15/10/2030                           | 174 530          | 0,01              |
| 50 000 3.300% JPMorgan Chase & Co 01/04/2026   | 48 258           | 0,00              | 50 000 2.956% JPMorgan Chase & Co 13/05/2031                            | 43 058           | 0,00              |
| 200 000 2.083% JPMorgan Chase & Co 22/04/2026  | 187 824          | 0,01              | 100 000 1.764% JPMorgan Chase & Co 19/11/2031                           | 79 760           | 0,00              |
| 100 000 4.080% JPMorgan Chase & Co 26/04/2026  | 98 095           | 0,01              | 150 000 1.953% JPMorgan Chase & Co 04/02/2032                           | 120 682          | 0,01              |
| 50 000 3.200% JPMorgan Chase & Co 15/06/2026   | 48 009           | 0,00              | 200 000 2.580% JPMorgan Chase & Co 22/04/2032                           | 168 466          | 0,01              |
| 200 000 4.125% JPMorgan Chase & Co 15/12/2026  | 195 294          | 0,01              | 200 000 2.963% JPMorgan Chase & Co 25/01/2033                           | 171 194          | 0,01              |
| 100 000 3.960% JPMorgan Chase & Co 29/01/2027  | 97 034           | 0,00              | 100 000 4.586% JPMorgan Chase & Co 26/04/2033                           | 96 902           | 0,00              |
| 100 000 1.040% JPMorgan Chase & Co 04/02/2027  | 89 252           | 0,00              | 300 000 4.912% JPMorgan Chase & Co 25/07/2033                           | 298 281          | 0,01              |
| 200 000 1.578% JPMorgan Chase & Co 22/04/2027  | 179 670          | 0,01              | 200 000 5.717% JPMorgan Chase & Co 14/09/2033                           | 204 062          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 3.882% JPMorgan Chase & Co<br>24/07/2038                        | 88 048           | 0,00              | 100 000 3.950% Keurig Dr Pepper Inc<br>15/04/2029                       | 95 879           | 0,00              |
| 100 000 3.109% JPMorgan Chase & Co<br>22/04/2041                        | 76 349           | 0,00              | 100 000 2.250% Keurig Dr Pepper Inc<br>15/03/2031                       | 83 854           | 0,00              |
| 200 000 5.600% JPMorgan Chase & Co<br>15/07/2041                        | 208 678          | 0,01              | 100 000 4.500% Keurig Dr Pepper Inc<br>15/04/2052                       | 88 886           | 0,00              |
| 100 000 2.525% JPMorgan Chase & Co<br>19/11/2041                        | 69 990           | 0,00              | 250 000 4.150% KeyBank NA/Cleveland OH<br>08/08/2025                    | 236 877          | 0,01              |
| 50 000 5.400% JPMorgan Chase & Co<br>06/01/2042                         | 51 378           | 0,00              | 50 000 4.150% KeyCorp 29/10/2025  | 47 025           | 0,00              |
| 100 000 3.157% JPMorgan Chase & Co<br>22/04/2042                        | 76 108           | 0,00              | 50 000 4.100% KeyCorp 30/04/2028  | 44 847           | 0,00              |
| 100 000 5.625% JPMorgan Chase & Co<br>16/08/2043                        | 103 087          | 0,01              | 200 000 3.000% Keysight Technologies Inc<br>30/10/2029                  | 176 896          | 0,01              |
| 250 000 4.850% JPMorgan Chase & Co<br>01/02/2044                        | 240 360          | 0,01              | 50 000 5.819% KeySpan Gas East Corp<br>01/04/2041                       | 49 942           | 0,00              |
| 100 000 4.260% JPMorgan Chase & Co<br>22/02/2048                        | 87 283           | 0,00              | 200 000 4.250% Kilroy Realty LP 15/08/2029                              | 166 400          | 0,01              |
| 100 000 3.897% JPMorgan Chase & Co<br>23/01/2049                        | 81 875           | 0,00              | 50 000 2.500% Kilroy Realty LP 15/11/2032                               | 31 519           | 0,00              |
| 100 000 3.109% JPMorgan Chase & Co<br>22/04/2051                        | 70 853           | 0,00              | 50 000 2.650% Kilroy Realty LP 15/11/2033                               | 31 058           | 0,00              |
| 100 000 3.328% JPMorgan Chase & Co<br>22/04/2052                        | 73 267           | 0,00              | 100 000 3.200% Kimberly-Clark Corp 25/04/2029                           | 94 746           | 0,00              |
| 200 000 2.250% JT International Financial<br>Services BV 14/09/2031     | 157 642          | 0,01              | 100 000 3.200% Kimberly-Clark Corp 30/07/2046                           | 77 474           | 0,00              |
| 150 000 3.750% Juniper Networks Inc<br>15/08/2029                       | 139 470          | 0,01              | 50 000 4.600% Kimco Realty OP LLC<br>01/02/2033                         | 46 871           | 0,00              |
| 125 000 4.875% Kaiser Foundation Hospitals<br>01/04/2042                | 122 246          | 0,01              | 150 000 4.450% Kimco Realty OP LLC<br>01/09/2047                        | 120 115          | 0,01              |
| 100 000 4.150% Kaiser Foundation Hospitals<br>01/05/2047                | 87 757           | 0,00              | 50 000 7.300% Kinder Morgan Energy<br>Partners LP 15/08/2033            | 55 980           | 0,00              |
| 50 000 3.266% Kaiser Foundation Hospitals<br>01/11/2049                 | 37 333           | 0,00              | 200 000 6.950% Kinder Morgan Energy<br>Partners LP 15/01/2038           | 223 844          | 0,01              |
| 150 000 2.875% Kansas City Southern/Old<br>15/11/2029                   | 134 451          | 0,01              | 100 000 6.550% Kinder Morgan Energy<br>Partners LP 15/09/2040           | 102 795          | 0,01              |
| 50 000 4.950% Kansas City Southern/Old<br>15/08/2045                    | 46 782           | 0,00              | 100 000 6.375% Kinder Morgan Energy<br>Partners LP 01/03/2041           | 103 146          | 0,01              |
| 200 000 5.375% KazMunayGas National Co JSC<br>24/04/2030                | 178 520          | 0,01              | 100 000 5.000% Kinder Morgan Energy<br>Partners LP 15/08/2042           | 89 079           | 0,00              |
| 200 000 6.375% KazMunayGas National Co JSC<br>24/10/2048                | 166 936          | 0,01              | 50 000 5.000% Kinder Morgan Energy<br>Partners LP 01/03/2043            | 44 001           | 0,00              |
| 50 000 2.100% Kellogg Co 01/06/2030                                     | 41 899           | 0,00              | 100 000 5.400% Kinder Morgan Energy<br>Partners LP 01/09/2044           | 92 464           | 0,00              |
| 100 000 2.400% Kemper Corp 30/09/2030                                   | 79 990           | 0,00              | 100 000 4.300% Kinder Morgan Inc 01/06/2025                             | 98 514           | 0,01              |
| 100 000 5.125% Kentucky Utilities Co<br>01/11/2040                      | 97 619           | 0,00              | 50 000 5.550% Kinder Morgan Inc 01/06/2045                              | 47 419           | 0,00              |
| 50 000 3.300% Kentucky Utilities Co<br>01/06/2050                       | 36 158           | 0,00              | 100 000 5.050% Kinder Morgan Inc 15/02/2046                             | 87 984           | 0,00              |
| 50 000 4.417% Keurig Dr Pepper Inc<br>25/05/2025                        | 49 441           | 0,00              | 150 000 3.600% Kinder Morgan Inc 15/02/2051                             | 106 239          | 0,01              |
|   |                  |                   | 100 000 5.450% Kinder Morgan Inc 01/08/2052                             | 92 986           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 4.750% Kite Realty Group Trust<br>15/09/2030                    | 90 343           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 5.500% KKR Group Finance Co II LLC<br>01/02/2043                | 95 086           | 0,00              |
|   |                  |                   | 50 000 5.125% KKR Group Finance Co III LLC<br>01/06/2044                | 43 843           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 150 000 3.500% KKR Group Finance Co VIII LLC<br>25/08/2050              | 100 963          | 0,01              |
| 100 000 3.250% KKR Group Finance Co X LLC<br>15/12/2051                 | 63 203           | 0,00              |
| 100 000 4.650% KLA Corp 01/11/2024                                      | 99 730           | 0,01              |
| 200 000 4.100% KLA Corp 15/03/2029                                      | 196 912          | 0,01              |
| 50 000 4.950% KLA Corp 15/07/2052                                       | 49 531           | 0,00              |
| 250 000 2.500% Korea Electric Power Corp<br>24/06/2024                  | 243 345          | 0,01              |
| 100 000 3.875% Kraft Heinz Foods Co<br>15/05/2027                       | 97 611           | 0,00              |
| 50 000 5.000% Kraft Heinz Foods Co<br>15/07/2035                        | 50 063           | 0,00              |
| 100 000 7.125% Kraft Heinz Foods Co<br>01/08/2039                       | 114 048          | 0,01              |
| 400 000 6.500% Kraft Heinz Foods Co<br>09/02/2040                       | 438 948          | 0,02              |
| 100 000 5.200% Kraft Heinz Foods Co<br>15/07/2045                       | 97 000           | 0,00              |
| 100 000 4.875% Kraft Heinz Foods Co<br>01/10/2049                       | 92 533           | 0,00              |
| 300 000 1.375% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>05/08/2024            | 288 198          | 0,01              |
| 200 000 0.500% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>20/09/2024            | 189 138          | 0,01              |
| 575 000 2.500% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>20/11/2024            | 558 871          | 0,02              |
| 400 000 1.250% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>31/01/2025            | 379 400          | 0,02              |
| 100 000 2.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>02/05/2025            | 95 835           | 0,00              |
| 150 000 3.125% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>10/06/2025            | 146 988          | 0,01              |
| 300 000 0.375% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>18/07/2025            | 276 378          | 0,01              |
| 350 000 0.625% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>22/01/2026            | 319 791          | 0,01              |
| 800 000 1.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>01/10/2026            | 727 128          | 0,03              |
| 200 000 3.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>20/05/2027            | 194 382          | 0,01              |
| 200 000 2.875% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>03/04/2028            | 192 466          | 0,01              |
| 200 000 1.750% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>14/09/2029            | 178 370          | 0,01              |
| 200 000 0.750% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>30/09/2030            | 162 890          | 0,01              |
| 50 000 0.000% Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>18/04/2036             | 30 574           | 0,00              |
| 50 000 2.650% Kroger Co 15/10/2026                                      | 47 094           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>             |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 50 000 6.900% Kroger Co 15/04/2038  | 57 010           | 0,00              |
| 50 000 3.875% Kroger Co 15/10/2046  | 39 359           | 0,00              |
| 50 000 4.450% Kroger Co 01/02/2047  | 44 035           | 0,00              |
| 100 000 5.400% Kroger Co 15/01/2049   | 98 716           | 0,01              |
| 50 000 3.950% Kroger Co 15/01/2050  | 40 705           | 0,00              |
| 100 000 4.100% Kyndryl Holdings Inc<br>15/10/2041                             | 66 897           | 0,00              |
| 250 000 4.400% L3Harris Technologies Inc<br>15/06/2028                        | 246 042          | 0,01              |
| 100 000 2.900% L3Harris Technologies Inc<br>15/12/2029                        | 88 329           | 0,00              |
| 50 000 1.800% L3Harris Technologies Inc<br>15/01/2031                         | 40 405           | 0,00              |
| 200 000 2.950% Laboratory Corp of America<br>Holdings 01/12/2029              | 178 794          | 0,01              |
| 50 000 4.700% Laboratory Corp of America<br>Holdings 01/02/2045               | 44 825           | 0,00              |
| 50 000 4.000% Lam Research Corp 15/03/2029                                    | 48 969           | 0,00              |
| 50 000 2.875% Lam Research Corp 15/06/2050                                    | 35 246           | 0,00              |
| 50 000 3.125% Lam Research Corp 15/06/2060                                    | 34 380           | 0,00              |
| 100 000 2.000% Landeskreditbank Baden-<br>Wuerttemberg Foerderbank 23/07/2024 | 96 784           | 0,00              |
| 100 000 1.375% Landeskreditbank Baden-<br>Wuerttemberg Foerderbank 27/01/2025 | 94 922           | 0,00              |
| 100 000 2.000% Landwirtschaftliche Rentenbank<br>13/01/2025                   | 96 221           | 0,00              |
| 200 000 0.500% Landwirtschaftliche Rentenbank<br>27/05/2025                   | 185 276          | 0,01              |
| 250 000 0.875% Landwirtschaftliche Rentenbank<br>30/03/2026                   | 228 665          | 0,01              |
| 200 000 3.875% Landwirtschaftliche Rentenbank<br>28/09/2027                   | 200 892          | 0,01              |
| 50 000 2.500% Landwirtschaftliche Rentenbank<br>15/11/2027                    | 47 317           | 0,00              |
| 200 000 0.875% Landwirtschaftliche Rentenbank<br>03/09/2030                   | 163 484          | 0,01              |
| 100 000 5.250% Lear Corp 15/05/2049   | 88 620           | 0,00              |
| 50 000 3.500% Leggett & Platt Inc 15/11/2027                                  | 46 797           | 0,00              |
| 50 000 4.400% Leggett & Platt Inc 15/03/2029                                  | 48 458           | 0,00              |
| 50 000 2.300% Leidos Inc 15/02/2031   | 40 647           | 0,00              |
| 100 000 4.500% Lennar Corp 30/04/2024   | 98 790           | 0,01              |
| 50 000 5.250% Lennar Corp 01/06/2026  | 50 177           | 0,00              |
| 100 000 5.500% Liberty Mutual Group Inc<br>15/06/2052                         | 95 212           | 0,00              |
| 100 000 3.950% Liberty Mutual Group Inc<br>15/05/2060                         | 71 224           | 0,00              |
| 200 000 2.050% Liberty Utilities Finance GP 1<br>15/09/2030                   | 158 220          | 0,01              |
| 50 000 3.875% Life Storage LP 15/12/2027                                      | 47 397           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 3.400% Lincoln National Corp 15/01/2031                          | 40 850           | 0,00              |
| 50 000 7.000% Lincoln National Corp 15/06/2040                          | 53 632           | 0,00              |
| 100 000 4.350% Lincoln National Corp 01/03/2048                         | 76 184           | 0,00              |
| 50 000 2.650% Linde Inc/CT 05/02/2025                                   | 48 307           | 0,00              |
| 50 000 3.550% Linde Inc/CT 07/11/2042                                   | 41 630           | 0,00              |
| 200 000 3.870% Lloyds Banking Group PLC 09/07/2025                      | 194 422          | 0,01              |
| 200 000 4.582% Lloyds Banking Group PLC 10/12/2025                      | 189 942          | 0,01              |
| 200 000 2.438% Lloyds Banking Group PLC 05/02/2026                      | 188 156          | 0,01              |
| 200 000 4.716% Lloyds Banking Group PLC 11/08/2026                      | 194 594          | 0,01              |
| 200 000 3.750% Lloyds Banking Group PLC 11/01/2027                      | 187 288          | 0,01              |
| 165 420 6.875% LLPL Capital Pte Ltd 04/02/2039                          | 146 731          | 0,01              |
| 200 000 4.950% Lockheed Martin Corp 15/10/2025                          | 203 224          | 0,01              |
| 25 000 3.550% Lockheed Martin Corp 15/01/2026                           | 24 748           | 0,00              |
| 50 000 1.850% Lockheed Martin Corp 15/06/2030                           | 42 452           | 0,00              |
| 100 000 3.900% Lockheed Martin Corp 15/06/2032                          | 96 948           | 0,00              |
| 100 000 6.150% Lockheed Martin Corp 01/09/2036                          | 113 720          | 0,01              |
| 175 000 3.800% Lockheed Martin Corp 01/03/2045                          | 150 925          | 0,01              |
| 100 000 3.750% Loews Corp 01/04/2026                                    | 97 448           | 0,00              |
| 50 000 3.200% Loews Corp 15/05/2030                                     | 44 940           | 0,00              |
| 50 000 4.250% Louisville Gas and Electric Co 01/04/2049                 | 43 146           | 0,00              |
| 100 000 3.350% Lowe's Cos Inc 01/04/2027                                | 96 009           | 0,00              |
| 200 000 3.100% Lowe's Cos Inc 03/05/2027                                | 189 944          | 0,01              |
| 100 000 1.700% Lowe's Cos Inc 15/09/2028                                | 86 567           | 0,00              |
| 100 000 3.650% Lowe's Cos Inc 05/04/2029                                | 94 573           | 0,00              |
| 100 000 2.800% Lowe's Cos Inc 15/09/2041                                | 70 738           | 0,00              |
| 50 000 3.700% Lowe's Cos Inc 15/04/2046                                 | 38 225           | 0,00              |
| 50 000 4.050% Lowe's Cos Inc 03/05/2047                                 | 40 447           | 0,00              |
| 200 000 3.000% Lowe's Cos Inc 15/10/2050                                | 132 776          | 0,01              |
| 100 000 4.250% Lowe's Cos Inc 01/04/2052                                | 82 216           | 0,00              |
| 100 000 5.625% Lowe's Cos Inc 15/04/2053                                | 100 510          | 0,01              |
| 50 000 4.450% Lowe's Cos Inc 01/04/2062                                 | 40 845           | 0,00              |
| 100 000 5.800% Lowe's Cos Inc 15/09/2062                                | 100 553          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 200 000 1.375% LSEGA Financing PLC 06/04/2026                           | 178 768          | 0,01              |
| 200 000 2.000% LSEGA Financing PLC 06/04/2028                           | 171 778          | 0,01              |
| 50 000 2.700% LXP Industrial Trust 15/09/2030                           | 40 818           | 0,00              |
| 100 000 2.375% LXP Industrial Trust 01/10/2031                          | 77 017           | 0,00              |
| 100 000 5.250% LYB International Finance BV 15/07/2043                  | 92 021           | 0,00              |
| 50 000 2.250% LYB International Finance III LLC 01/10/2030              | 41 272           | 0,00              |
| 100 000 4.200% LYB International Finance III LLC 01/05/2050             | 78 427           | 0,00              |
| 100 000 3.625% LYB International Finance III LLC 01/04/2051             | 71 095           | 0,00              |
| 100 000 4.625% LyondellBasell Industries NV 26/02/2055                  | 81 706           | 0,00              |
| 200 000 2.300% Macquarie Bank Ltd 22/01/2025                            | 191 232          | 0,01              |
| 50 000 3.231% Macquarie Bank Ltd 21/03/2025                             | 48 455           | 0,00              |
| 200 000 3.052% Macquarie Bank Ltd 03/03/2036                            | 153 094          | 0,01              |
| 100 000 6.207% Macquarie Group Ltd 22/11/2024                           | 101 679          | 0,01              |
| 200 000 1.340% Macquarie Group Ltd 12/01/2027                           | 178 522          | 0,01              |
| 50 000 1.629% Macquarie Group Ltd 23/09/2027                            | 43 941           | 0,00              |
| 50 000 5.033% Macquarie Group Ltd 15/01/2030                            | 49 545           | 0,00              |
| 200 000 2.871% Macquarie Group Ltd 14/01/2033                           | 162 026          | 0,01              |
| 50 000 3.250% Magellan Midstream Partners LP 01/06/2030                 | 45 105           | 0,00              |
| 50 000 4.250% Magellan Midstream Partners LP 15/09/2046                 | 39 786           | 0,00              |
| 50 000 4.850% Magellan Midstream Partners LP 01/02/2049                 | 43 496           | 0,00              |
| 50 000 3.950% Magellan Midstream Partners LP 01/03/2050                 | 37 914           | 0,00              |
| 100 000 3.625% Magna International Inc 15/06/2024                       | 98 152           | 0,01              |
| 100 000 2.450% Magna International Inc 15/06/2030                       | 84 885           | 0,00              |
| 50 000 4.150% Manulife Financial Corp 04/03/2026                        | 49 214           | 0,00              |
| 50 000 4.061% Manulife Financial Corp 24/02/2032                        | 47 442           | 0,00              |
| 50 000 3.703% Manulife Financial Corp 16/03/2032                        | 46 162           | 0,00              |
| 200 000 2.210% MAR Sukuk Ltd 02/09/2025                                 | 186 800          | 0,01              |
| 50 000 4.400% Marathon Oil Corp 15/07/2027                              | 48 473           | 0,00              |
| 100 000 6.800% Marathon Oil Corp 15/03/2032                             | 105 588          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 3.625% Marathon Petroleum Corp 15/09/2024                       | 98 342           | 0,01              |
| 100 000 5.125% Marathon Petroleum Corp 15/12/2026                       | 100 892          | 0,01              |
| 25 000 3.800% Marathon Petroleum Corp 01/04/2028                        | 23 937           | 0,00              |
| 50 000 4.750% Marathon Petroleum Corp 15/09/2044                        | 43 032           | 0,00              |
| 100 000 5.000% Markel Corp 05/04/2046                                   | 91 349           | 0,00              |
| 50 000 5.000% Markel Corp 20/05/2049                                    | 45 839           | 0,00              |
| 50 000 4.150% Markel Corp 17/09/2050                                    | 40 069           | 0,00              |
| 50 000 3.125% Marriott International Inc/MD 15/06/2026                  | 47 196           | 0,00              |
| 100 000 5.000% Marriott International Inc/MD 15/10/2027                 | 100 228          | 0,01              |
| 100 000 2.850% Marriott International Inc/MD 15/04/2031                 | 85 212           | 0,00              |
| 50 000 3.500% Marriott International Inc/MD 15/10/2032                  | 43 825           | 0,00              |
| 150 000 2.700% Mars Inc 01/04/2025                                      | 144 114          | 0,01              |
| 150 000 1.625% Mars Inc 16/07/2032                                      | 117 723          | 0,01              |
| 100 000 3.600% Mars Inc 01/04/2034                                      | 90 067           | 0,00              |
| 50 000 2.450% Mars Inc 16/07/2050                                       | 31 758           | 0,00              |
| 150 000 4.750% Marsh & McLennan Cos Inc 15/03/2039                      | 141 465          | 0,01              |
| 50 000 2.500% Martin Marietta Materials Inc 15/03/2030                  | 42 476           | 0,00              |
| 100 000 2.400% Martin Marietta Materials Inc 15/07/2031                 | 82 034           | 0,00              |
| 50 000 3.200% Martin Marietta Materials Inc 15/07/2051                  | 35 349           | 0,00              |
| 250 000 1.319% Marubeni Corp 18/09/2025                                 | 227 735          | 0,01              |
| 100 000 2.450% Marvell Technology Inc 15/04/2028                        | 87 244           | 0,00              |
| 50 000 1.500% Masco Corp 15/02/2028                                     | 42 679           | 0,00              |
| 50 000 4.500% Masco Corp 15/05/2047                                     | 41 527           | 0,00              |
| 50 000 4.117% Mass General Brigham Inc 01/07/2055                       | 41 881           | 0,00              |
| 100 000 4.004% Massachusetts Electric Co 15/08/2046                     | 77 122           | 0,00              |
| 100 000 2.989% Massachusetts Institute of Technology 01/07/2050         | 76 189           | 0,00              |
| 50 000 2.294% Massachusetts Institute of Technology 01/07/2051          | 32 658           | 0,00              |
| 50 000 3.375% Massachusetts Mutual Life Insurance Co 15/04/2050         | 36 555           | 0,00              |
| 50 000 3.729% Massachusetts Mutual Life Insurance Co 15/10/2070         | 34 704           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 4.900% Massachusetts Mutual Life Insurance Co 01/04/2077         | 43 338           | 0,00              |
| 200 000 2.950% MassMutual Global Funding II 11/01/2025                  | 193 338          | 0,01              |
| 200 000 5.050% MassMutual Global Funding II 07/12/2027                  | 202 960          | 0,01              |
| 50 000 2.000% Mastercard Inc 03/03/2025                                 | 47 822           | 0,00              |
| 100 000 2.950% Mastercard Inc 21/11/2026                                | 95 791           | 0,00              |
| 50 000 3.300% Mastercard Inc 26/03/2027                                 | 48 430           | 0,00              |
| 100 000 3.800% Mastercard Inc 21/11/2046                                | 87 200           | 0,00              |
| 50 000 3.650% Mastercard Inc 01/06/2049                                 | 42 733           | 0,00              |
| 50 000 4.000% Mayo Clinic 15/11/2047                                    | 43 552           | 0,00              |
| 50 000 3.196% Mayo Clinic 15/11/2061                                    | 34 805           | 0,00              |
| 50 000 0.900% McCormick & Co Inc/MD 15/02/2026                          | 44 857           | 0,00              |
| 100 000 3.400% McCormick & Co Inc/MD 15/08/2027                         | 94 819           | 0,00              |
| 50 000 3.375% McDonald's Corp 26/05/2025                                | 48 821           | 0,00              |
| 50 000 3.300% McDonald's Corp 01/07/2025                                | 48 984           | 0,00              |
| 50 000 3.700% McDonald's Corp 30/01/2026                                | 49 156           | 0,00              |
| 100 000 2.625% McDonald's Corp 01/09/2029                               | 90 800           | 0,00              |
| 100 000 3.600% McDonald's Corp 01/07/2030                               | 94 888           | 0,00              |
| 300 000 4.700% McDonald's Corp 09/12/2035                               | 299 475          | 0,01              |
| 100 000 6.300% McDonald's Corp 15/10/2037                               | 114 007          | 0,01              |
| 142 000 3.700% McDonald's Corp 15/02/2042                               | 117 641          | 0,01              |
| 150 000 4.875% McDonald's Corp 09/12/2045                               | 145 372          | 0,01              |
| 50 000 4.450% McDonald's Corp 01/09/2048                                | 46 299           | 0,00              |
| 50 000 3.625% McDonald's Corp 01/09/2049                                | 40 008           | 0,00              |
| 50 000 1.300% McKesson Corp 15/08/2026                                  | 44 803           | 0,00              |
| 50 000 4.386% McLaren Health Care Corp 15/05/2048                       | 44 688           | 0,00              |
| 150 000 6.000% MDC Holdings Inc 15/01/2043                              | 130 240          | 0,01              |
| 200 000 3.000% MDGH GMTN RSC Ltd 19/04/2024                             | 195 482          | 0,01              |
| 200 000 5.500% MDGH GMTN RSC Ltd 28/04/2033                             | 212 704          | 0,01              |
| 200 000 3.700% MDGH GMTN RSC Ltd 07/11/2049                             | 163 524          | 0,01              |
| 200 000 3.950% MDGH GMTN RSC Ltd 21/05/2050                             | 169 140          | 0,01              |
| 36 000 4.375% Medtronic Inc 15/03/2035                                  | 35 464           | 0,00              |
| 200 000 5.000% MEGlobal Canada ULC 18/05/2025                           | 197 874          | 0,01              |
| 150 000 5.000% Memorial Sloan-Kettering Cancer Center 01/07/2042        | 152 833          | 0,01              |
| 50 000 2.955% Memorial Sloan-Kettering Cancer Center 01/01/2050         | 35 327           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                                   |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>                             |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 200 000 3.500% Mercedes-Benz Finance North America LLC 03/08/2025       | 194 642          | 0,01              | 100 000 3.500% Microsoft Corp 15/11/2042  | 89 080           | 0,00              |
| 150 000 1.450% Mercedes-Benz Finance North America LLC 02/03/2026       | 137 233          | 0,01              | 337 000 2.525% Microsoft Corp 01/06/2050  | 237 339          | 0,01              |
| 228 000 3.100% Mercedes-Benz Finance North America LLC 15/08/2029       | 208 061          | 0,01              | 263 000 2.921% Microsoft Corp 17/03/2052  | 199 299          | 0,01              |
| 50 000 2.750% Merck & Co Inc 10/02/2025                                 | 48 920           | 0,00              | 450 000 2.675% Microsoft Corp 01/06/2060  | 310 815          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Merck & Co Inc 24/02/2026                                | 91 505           | 0,00              | 100 000 3.041% Microsoft Corp 17/03/2062  | 75 003           | 0,00              |
| 100 000 1.700% Merck & Co Inc 10/06/2027                                | 90 892           | 0,00              | 50 000 4.000% Mid-America Apartments LP 15/11/2025  | 48 776           | 0,00              |
| 150 000 3.400% Merck & Co Inc 07/03/2029                                | 144 201          | 0,01              | 200 000 1.100% Mid-America Apartments LP 15/09/2026   | 176 086          | 0,01              |
| 50 000 1.450% Merck & Co Inc 24/06/2030                                 | 41 317           | 0,00              | 50 000 3.500% MidAmerican Energy Co 15/10/2024  | 48 967           | 0,00              |
| 50 000 2.150% Merck & Co Inc 10/12/2031                                 | 42 240           | 0,00              | 100 000 3.950% MidAmerican Energy Co 01/08/2047   | 85 694           | 0,00              |
| 100 000 6.500% Merck & Co Inc 01/12/2033                                | 117 262          | 0,01              | 50 000 4.250% MidAmerican Energy Co 15/07/2049  | 44 729           | 0,00              |
| 150 000 2.350% Merck & Co Inc 24/06/2040                                | 110 599          | 0,01              | 100 000 3.150% MidAmerican Energy Co 15/04/2050   | 73 617           | 0,00              |
| 50 000 4.150% Merck & Co Inc 18/05/2043                                 | 46 868           | 0,00              | 50 000 4.100% Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC 15/05/2028                                   | 48 238           | 0,00              |
| 150 000 4.000% Merck & Co Inc 07/03/2049                                | 134 664          | 0,01              | 170 000 6.500% Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd 20/06/2027 | 169 595          | 0,01              |
| 50 000 2.750% Merck & Co Inc 10/12/2051                                 | 35 399           | 0,00              | 200 000 4.200% Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd 27/07/2026                                       | 195 664          | 0,01              |
| 150 000 2.900% Merck & Co Inc 10/12/2061                                | 102 810          | 0,01              | 200 000 5.080% Mitsubishi HC Capital Inc 15/09/2027   | 199 562          | 0,01              |
| 200 000 3.850% Meta Platforms Inc 15/08/2032                            | 187 316          | 0,01              | 200 000 2.801% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 18/07/2024  | 192 838          | 0,01              |
| 200 000 4.450% Meta Platforms Inc 15/08/2052                            | 176 066          | 0,01              | 200 000 4.788% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 18/07/2025  | 197 962          | 0,01              |
| 100 000 4.650% Meta Platforms Inc 15/08/2062                            | 88 528           | 0,00              | 200 000 0.962% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 11/10/2025  | 186 258          | 0,01              |
| 50 000 3.000% MetLife Inc 01/03/2025                                    | 48 380           | 0,00              | 400 000 2.341% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 19/01/2028  | 359 184          | 0,01              |
| 100 000 3.600% MetLife Inc 13/11/2025                                   | 97 964           | 0,00              | 200 000 5.017% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 20/07/2028  | 198 454          | 0,01              |
| 250 000 4.550% MetLife Inc 23/03/2030                                   | 246 237          | 0,01              | 200 000 5.354% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 13/09/2028  | 200 618          | 0,01              |
| 100 000 5.700% MetLife Inc 15/06/2035                                   | 105 650          | 0,01              | 200 000 2.309% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 20/07/2032  | 160 250          | 0,01              |
| 150 000 4.875% MetLife Inc 13/11/2043                                   | 139 914          | 0,01              | 200 000 2.494% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 13/10/2032  | 161 482          | 0,01              |
| 100 000 5.000% MetLife Inc 15/07/2052                                   | 93 469           | 0,00              | 200 000 2.852% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 19/01/2033  | 165 066          | 0,01              |
| 100 000 4.300% Metropolitan Edison Co 15/01/2029                        | 95 906           | 0,00              | 150 000 4.286% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 26/07/2038  | 135 529          | 0,01              |
| 150 000 1.875% Metropolitan Life Global Funding I 11/01/2027            | 133 791          | 0,01              | 200 000 2.226% Mizuho Financial Group Inc 25/05/2026  | 186 802          | 0,01              |
| 263 000 5.500% Mexico City Airport Trust 31/07/2047                     | 204 212          | 0,01              | 200 000 1.234% Mizuho Financial Group Inc 22/05/2027  | 175 748          | 0,01              |
| 100 000 4.185% Micron Technology Inc 15/02/2027                         | 96 610           | 0,00              |   |                  |                   |
| 50 000 4.663% Micron Technology Inc 15/02/2030                          | 47 996           | 0,00              |   |                  |                   |
| 100 000 2.703% Micron Technology Inc 15/04/2032                         | 80 019           | 0,00              |   |                  |                   |
| 50 000 3.477% Micron Technology Inc 01/11/2051                          | 32 600           | 0,00              |   |                  |                   |
| 150 000 2.700% Microsoft Corp 12/02/2025                                | 146 257          | 0,01              |   |                  |                   |
| 50 000 3.125% Microsoft Corp 03/11/2025                                 | 48 772           | 0,00              |   |                  |                   |
| 150 000 2.400% Microsoft Corp 08/08/2026                                | 142 660          | 0,01              |   |                  |                   |
| 200 000 3.300% Microsoft Corp 06/02/2027                                | 196 208          | 0,01              |   |                  |                   |
| 50 000 3.500% Microsoft Corp 12/02/2035                                 | 47 443           | 0,00              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>        |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                                |                  |                   |
| 200 000 5.414% Mizuho Financial Group Inc 13/09/2028                     | 200 786          | 0,01              |
| 200 000 2.591% Mizuho Financial Group Inc 25/05/2031                     | 166 420          | 0,01              |
| 200 000 2.201% Mizuho Financial Group Inc 10/07/2031                     | 162 690          | 0,01              |
| 200 000 2.564% Mizuho Financial Group Inc 13/09/2031                     | 157 434          | 0,01              |
| 200 000 3.000% Molson Coors Beverage Co 15/07/2026                       | 188 848          | 0,01              |
| 100 000 5.000% Molson Coors Beverage Co 01/05/2042                       | 93 979           | 0,00              |
| 200 000 4.250% Mondelez International Holdings Netherlands BV 15/09/2025 | 197 674          | 0,01              |
| 100 000 3.000% Mondelez International Inc 17/03/2032                     | 88 033           | 0,00              |
| 50 000 4.100% Monongahela Power Co 15/04/2024                            | 48 956           | 0,00              |
| 150 000 4.287% Montefiore Obligated Group 01/09/2050                     | 92 826           | 0,00              |
| 100 000 3.250% Moody's Corp 15/01/2028                                   | 94 290           | 0,00              |
| 50 000 2.000% Moody's Corp 19/08/2031                                    | 40 881           | 0,00              |
| 200 000 4.250% Moody's Corp 08/08/2032                                   | 192 614          | 0,01              |
| 150 000 2.750% Moody's Corp 19/08/2041                                   | 107 662          | 0,01              |
| 100 000 3.620% Morgan Stanley 17/04/2025                                 | 98 152           | 0,01              |
| 200 000 0.864% Morgan Stanley 21/10/2025                                 | 185 850          | 0,01              |
| 100 000 1.164% Morgan Stanley 21/10/2025                                 | 93 403           | 0,00              |
| 300 000 5.000% Morgan Stanley 24/11/2025                                 | 298 527          | 0,01              |
| 100 000 2.630% Morgan Stanley 18/02/2026                                 | 94 974           | 0,00              |
| 150 000 2.188% Morgan Stanley 28/04/2026                                 | 140 952          | 0,01              |
| 100 000 4.679% Morgan Stanley 17/07/2026                                 | 98 662           | 0,01              |
| 50 000 3.125% Morgan Stanley 27/07/2026                                  | 47 381           | 0,00              |
| 177 000 6.250% Morgan Stanley 09/08/2026                                 | 184 861          | 0,01              |
| 100 000 4.350% Morgan Stanley 08/09/2026                                 | 97 556           | 0,00              |
| 200 000 6.138% Morgan Stanley 16/10/2026                                 | 204 608          | 0,01              |
| 50 000 5.050% Morgan Stanley 28/01/2027                                  | 49 906           | 0,00              |
| 200 000 3.950% Morgan Stanley 23/04/2027                                 | 193 204          | 0,01              |
| 100 000 1.593% Morgan Stanley 04/05/2027                                 | 90 058           | 0,00              |
| 200 000 1.512% Morgan Stanley 20/07/2027                                 | 177 474          | 0,01              |
| 150 000 2.475% Morgan Stanley 21/01/2028                                 | 137 149          | 0,01              |
| 100 000 4.210% Morgan Stanley 20/04/2028                                 | 97 148           | 0,00              |
| 175 000 3.591% Morgan Stanley 22/07/2028                                 | 165 424          | 0,01              |
| 200 000 6.296% Morgan Stanley 18/10/2028                                 | 210 382          | 0,01              |
| 200 000 3.772% Morgan Stanley 24/01/2029                                 | 189 502          | 0,01              |
| 50 000 5.123% Morgan Stanley 01/02/2029                                  | 50 313           | 0,00              |
| 100 000 4.431% Morgan Stanley 23/01/2030                                 | 96 250           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                     |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>               |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 250 000 2.699% Morgan Stanley 22/01/2031  | 215 230          | 0,01              |
| 200 000 3.622% Morgan Stanley 01/04/2031  | 183 098          | 0,01              |
| 150 000 1.794% Morgan Stanley 13/02/2032  | 117 775          | 0,01              |
| 150 000 1.928% Morgan Stanley 28/04/2032  | 118 606          | 0,01              |
| 250 000 2.239% Morgan Stanley 21/07/2032  | 201 097          | 0,01              |
| 100 000 2.511% Morgan Stanley 20/10/2032  | 81 850           | 0,00              |
| 50 000 2.943% Morgan Stanley 21/01/2033   | 42 379           | 0,00              |
| 100 000 4.889% Morgan Stanley 20/07/2033  | 98 155           | 0,01              |
| 50 000 6.342% Morgan Stanley 18/10/2033   | 54 664           | 0,00              |
| 100 000 2.484% Morgan Stanley 16/09/2036  | 75 628           | 0,00              |
| 100 000 5.297% Morgan Stanley 20/04/2037  | 94 254           | 0,00              |
| 100 000 3.971% Morgan Stanley 22/07/2038  | 88 163           | 0,00              |
| 100 000 4.457% Morgan Stanley 22/04/2039  | 91 767           | 0,00              |
| 100 000 3.217% Morgan Stanley 22/04/2042  | 77 214           | 0,00              |
| 50 000 4.300% Morgan Stanley 27/01/2045   | 43 850           | 0,00              |
| 100 000 5.597% Morgan Stanley 24/03/2051  | 105 689          | 0,01              |
| 250 000 2.802% Morgan Stanley 25/01/2052  | 165 087          | 0,01              |
| 350 000 3.741% Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C17 15/08/2047 | 340 638          | 0,01              |
| 100 000 3.536% Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C34 15/11/2052 | 92 621           | 0,00              |
| 43 000 3.049% Morgan Stanley Capital I Trust 2016-BNK2 15/11/2049                     | 39 596           | 0,00              |
| 70 000 3.594% Morgan Stanley Capital I Trust 2016-UBS9 15/03/2049                     | 66 392           | 0,00              |
| 250 000 4.177% Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 15/07/2051                      | 236 597          | 0,01              |
| 50 000 4.500% Morgan Stanley Domestic Holdings Inc 20/06/2028                         | 49 415           | 0,00              |
| 100 000 5.450% Mosaic Co 15/11/2033   | 100 554          | 0,01              |
| 50 000 4.600% Motorola Solutions Inc 23/02/2028                                       | 49 353           | 0,00              |
| 50 000 2.300% Motorola Solutions Inc 15/11/2030                                       | 40 624           | 0,00              |
| 50 000 3.737% Mount Sinai Hospitals Group Inc 01/07/2049                              | 38 830           | 0,00              |
| 100 000 4.000% MPLX LP 15/02/2025   | 97 944           | 0,00              |
| 200 000 1.750% MPLX LP 01/03/2026   | 182 618          | 0,01              |
| 100 000 4.250% MPLX LP 01/12/2027   | 97 044           | 0,00              |
| 100 000 4.950% MPLX LP 01/09/2032   | 97 964           | 0,00              |
| 100 000 4.500% MPLX LP 15/04/2038   | 88 707           | 0,00              |
| 100 000 5.200% MPLX LP 01/03/2047   | 89 658           | 0,00              |
| 50 000 4.700% MPLX LP 15/04/2048  | 41 995           | 0,00              |
| 50 000 5.500% MPLX LP 15/02/2049  | 46 544           | 0,00              |
| 100 000 4.950% MPLX LP 14/03/2052   | 86 825           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>           |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>     |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                                   |                  |                   |
| 200 000 4.550% Mylan Inc 15/04/2028   | 191 888          | 0,01              |
| 50 000 5.200% Mylan Inc 15/04/2048  | 39 411           | 0,00              |
| 150 000 3.395% Narragansett Electric Co 09/04/2030                          | 137 482          | 0,01              |
| 150 000 3.850% Nasdaq Inc 30/06/2026  | 146 325          | 0,01              |
| 50 000 3.950% Nasdaq Inc 07/03/2052   | 38 765           | 0,00              |
| 250 000 3.933% National Australia Bank Ltd 02/08/2034                       | 219 227          | 0,01              |
| 250 000 3.347% National Australia Bank Ltd 12/01/2037                       | 201 465          | 0,01              |
| 250 000 3.905% National Australia Bank Ltd/New York 09/06/2027              | 242 715          | 0,01              |
| 100 000 5.200% National Fuel Gas Co 15/07/2025                              | 99 727           | 0,01              |
| 50 000 4.300% National Retail Properties Inc 15/10/2028                     | 47 134           | 0,00              |
| 50 000 4.800% National Retail Properties Inc 15/10/2048                     | 42 304           | 0,00              |
| 150 000 1.000% National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 15/06/2026 | 132 963          | 0,01              |
| 150 000 3.050% National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 25/04/2027 | 142 413          | 0,01              |
| 100 000 3.400% National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 07/02/2028 | 95 196           | 0,00              |
| 50 000 4.800% National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 15/03/2028  | 50 497           | 0,00              |
| 50 000 2.750% National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 15/04/2032  | 42 612           | 0,00              |
| 100 000 3.900% Nationwide Financial Services Inc 30/11/2049                 | 75 641           | 0,00              |
| 100 000 8.250% Nationwide Mutual Insurance Co 01/12/2031                    | 115 930          | 0,01              |
| 50 000 7.875% Nationwide Mutual Insurance Co 01/04/2033                     | 57 481           | 0,00              |
| 100 000 4.350% Nationwide Mutual Insurance Co 30/04/2050                    | 77 972           | 0,00              |
| 200 000 5.516% NatWest Group PLC 30/09/2028                                 | 198 340          | 0,01              |
| 200 000 3.754% NatWest Group PLC 01/11/2029                                 | 187 564          | 0,01              |
| 200 000 5.076% NatWest Group PLC 27/01/2030                                 | 194 256          | 0,01              |
| 200 000 1.500% NAVER Corp 29/03/2026  | 180 246          | 0,01              |
| 50 000 5.950% NBCUniversal Media LLC 01/04/2041                             | 54 294           | 0,00              |
| 200 000 4.450% NBCUniversal Media LLC 15/01/2043                            | 182 704          | 0,01              |
| 200 000 0.606% Nestle Holdings Inc 14/09/2024                               | 188 398          | 0,01              |
| 150 000 4.000% Nestle Holdings Inc 12/09/2025                               | 149 316          | 0,01              |
| 150 000 1.500% Nestle Holdings Inc 14/09/2028                               | 130 395          | 0,01              |
| 150 000 4.300% Nestle Holdings Inc 01/10/2032                               | 151 641          | 0,01              |
| 150 000 3.900% Nestle Holdings Inc 24/09/2038                               | 139 570          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                   |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>             |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 150 000 4.000% Nestle Holdings Inc 24/09/2048                                       | 134 641          | 0,01              |
| 150 000 4.700% Nestle Holdings Inc 15/01/2053                                       | 151 170          | 0,01              |
| 200 000 3.300% NetApp Inc 29/09/2024  | 194 578          | 0,01              |
| 50 000 1.875% NetApp Inc 22/06/2025   | 46 666           | 0,00              |
| 50 000 4.875% Neuberger Berman Group LLC / Neuberger Berman Finance Corp 15/04/2045 | 41 330           | 0,00              |
| 50 000 2.400% Nevada Power Co 01/05/2030  | 43 351           | 0,00              |
| 200 000 0.625% New Development Bank 22/07/2024                                      | 188 886          | 0,01              |
| 100 000 2.606% New York and Presbyterian Hospital 01/08/2060                        | 60 682           | 0,00              |
| 50 000 2.875% New York Life Global Funding 10/04/2024                               | 49 013           | 0,00              |
| 50 000 3.150% New York Life Global Funding 06/06/2024                               | 49 037           | 0,00              |
| 50 000 2.000% New York Life Global Funding 22/01/2025                               | 47 613           | 0,00              |
| 250 000 0.950% New York Life Global Funding 24/06/2025                              | 230 210          | 0,01              |
| 50 000 0.850% New York Life Global Funding 15/01/2026                               | 45 091           | 0,00              |
| 200 000 5.875% New York Life Insurance Co 15/05/2033                                | 210 802          | 0,01              |
| 50 000 6.750% New York Life Insurance Co 15/11/2039                                 | 58 356           | 0,00              |
| 100 000 4.450% New York Life Insurance Co 15/05/2069                                | 87 729           | 0,00              |
| 50 000 2.150% New York State Electric & Gas Corp 01/10/2031                         | 40 176           | 0,00              |
| 100 000 4.400% Newcastle Coal Infrastructure Group Pty Ltd 29/09/2027               | 89 673           | 0,00              |
| 50 000 4.700% Newcastle Coal Infrastructure Group Pty Ltd 12/05/2031                | 40 792           | 0,00              |
| 150 000 3.250% Newcrest Finance Pty Ltd 13/05/2030                                  | 131 583          | 0,01              |
| 100 000 2.250% Newmont Corp 01/10/2030  | 83 957           | 0,00              |
| 100 000 2.600% Newmont Corp 15/07/2032  | 83 577           | 0,00              |
| 50 000 4.875% Newmont Corp 15/03/2042   | 47 821           | 0,00              |
| 150 000 4.450% NextEra Energy Capital Holdings Inc 20/06/2025                       | 149 340          | 0,01              |
| 100 000 3.550% NextEra Energy Capital Holdings Inc 01/05/2027                       | 95 765           | 0,00              |
| 250 000 4.625% NextEra Energy Capital Holdings Inc 15/07/2027                       | 249 395          | 0,01              |
| 200 000 1.900% NextEra Energy Capital Holdings Inc 15/06/2028                       | 175 932          | 0,01              |
| 50 000 3.500% NextEra Energy Capital Holdings Inc 01/04/2029                        | 46 943           | 0,00              |



## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 2.750% NextEra Energy Capital Holdings Inc 01/11/2029            | 44 468           | 0,00              |
| 50 000 2.440% NextEra Energy Capital Holdings Inc 15/01/2032            | 41 458           | 0,00              |
| 100 000 5.000% NextEra Energy Capital Holdings Inc 15/07/2032           | 100 830          | 0,01              |
| 100 000 7.768% NGPL PipeCo LLC 15/12/2037                               | 109 809          | 0,01              |
| 100 000 3.508% Niagara Mohawk Power Corp 01/10/2024                     | 96 563           | 0,00              |
| 100 000 4.278% Niagara Mohawk Power Corp 15/12/2028                     | 94 406           | 0,00              |
| 50 000 4.278% Niagara Mohawk Power Corp 01/10/2034                      | 45 810           | 0,00              |
| 50 000 2.400% NIKE Inc 27/03/2025                                       | 48 534           | 0,00              |
| 50 000 2.750% NIKE Inc 27/03/2027                                       | 47 542           | 0,00              |
| 50 000 2.850% NIKE Inc 27/03/2030                                       | 45 974           | 0,00              |
| 100 000 3.250% NIKE Inc 27/03/2040                                      | 84 786           | 0,00              |
| 100 000 3.375% NIKE Inc 01/11/2046                                      | 81 686           | 0,00              |
| 200 000 2.750% Nippon Life Insurance Co 21/01/2051                      | 158 942          | 0,01              |
| 50 000 3.490% NiSource Inc 15/05/2027                                   | 47 406           | 0,00              |
| 50 000 3.600% NiSource Inc 01/05/2030                                   | 46 203           | 0,00              |
| 100 000 1.700% NiSource Inc 15/02/2031                                  | 79 227           | 0,00              |
| 100 000 4.800% NiSource Inc 15/02/2044                                  | 92 484           | 0,00              |
| 100 000 5.650% NiSource Inc 01/02/2045                                  | 103 954          | 0,01              |
| 50 000 3.950% NiSource Inc 30/03/2048                                   | 40 748           | 0,00              |
| 200 000 5.099% Nomura Holdings Inc 03/07/2025                           | 196 664          | 0,01              |
| 200 000 1.851% Nomura Holdings Inc 16/07/2025                           | 183 242          | 0,01              |
| 200 000 2.172% Nomura Holdings Inc 14/07/2028                           | 167 290          | 0,01              |
| 200 000 3.600% Nordea Bank Abp 06/06/2025                               | 193 140          | 0,01              |
| 200 000 0.750% Nordea Bank Abp 28/08/2025                               | 179 324          | 0,01              |
| 200 000 4.750% Nordea Bank Abp 22/09/2025                               | 199 646          | 0,01              |
| 200 000 1.500% Nordea Bank Abp 30/09/2026                               | 175 832          | 0,01              |
| 200 000 5.375% Nordea Bank Abp 22/09/2027                               | 200 896          | 0,01              |
| 200 000 0.375% Nordic Investment Bank 20/09/2024                        | 188 874          | 0,01              |
| 200 000 0.500% Nordic Investment Bank 21/01/2026                        | 182 028          | 0,01              |
| 200 000 3.375% Nordic Investment Bank 08/09/2027                        | 196 746          | 0,01              |
| 100 000 3.800% Norfolk Southern Corp 01/08/2028                         | 96 269           | 0,00              |
| 50 000 3.950% Norfolk Southern Corp 01/10/2042                          | 42 380           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 4.150% Norfolk Southern Corp 28/02/2048                          | 42 411           | 0,00              |
| 100 000 4.100% Norfolk Southern Corp 15/05/2049                         | 83 407           | 0,00              |
| 100 000 3.050% Norfolk Southern Corp 15/05/2050                         | 69 401           | 0,00              |
| 50 000 2.900% Norfolk Southern Corp 25/08/2051                          | 33 145           | 0,00              |
| 50 000 4.050% Norfolk Southern Corp 15/08/2052                          | 41 426           | 0,00              |
| 50 000 3.155% Norfolk Southern Corp 15/05/2055                          | 34 250           | 0,00              |
| 50 000 4.100% Norfolk Southern Corp 15/05/2121                          | 35 372           | 0,00              |
| 50 000 2.894% Northeastern University 01/10/2050                        | 35 111           | 0,00              |
| 100 000 4.300% Northern Natural Gas Co 15/01/2049                       | 83 404           | 0,00              |
| 100 000 5.350% Northern States Power Co/MN 01/11/2039                   | 103 712          | 0,01              |
| 50 000 3.600% Northern States Power Co/MN 15/05/2046                    | 39 696           | 0,00              |
| 100 000 2.900% Northern States Power Co/MN 01/03/2050                   | 70 674           | 0,00              |
| 100 000 2.600% Northern States Power Co/MN 01/06/2051                   | 66 254           | 0,00              |
| 200 000 4.000% Northern Trust Corp 10/05/2027                           | 195 868          | 0,01              |
| 100 000 1.950% Northern Trust Corp 01/05/2030                           | 83 418           | 0,00              |
| 50 000 3.375% Northern Trust Corp 08/05/2032                            | 45 197           | 0,00              |
| 50 000 2.930% Northrop Grumman Corp 15/01/2025                          | 48 469           | 0,00              |
| 50 000 3.250% Northrop Grumman Corp 15/01/2028                          | 47 513           | 0,00              |
| 50 000 4.750% Northrop Grumman Corp 01/06/2043                          | 48 125           | 0,00              |
| 75 000 4.030% Northrop Grumman Corp 15/10/2047                          | 65 251           | 0,00              |
| 100 000 4.260% Northwell Healthcare Inc 01/11/2047                      | 85 361           | 0,00              |
| 50 000 4.000% Northwest Pipeline LLC 01/04/2027                         | 48 411           | 0,00              |
| 100 000 6.063% Northwestern Mutual Life Insurance Co 30/03/2040         | 104 563          | 0,01              |
| 150 000 3.850% Northwestern Mutual Life Insurance Co 30/09/2047         | 119 184          | 0,01              |
| 200 000 3.450% Northwestern Mutual Life Insurance Co 30/03/2051         | 145 802          | 0,01              |
| 50 000 2.640% Northwestern University 01/12/2050                        | 34 868           | 0,00              |
| 50 000 3.662% Northwestern University 01/12/2057                        | 40 630           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 3.600% NOV Inc 01/12/2029                                       | 90 495           | 0,00              | 100 000 4.300% NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 18/06/2029        | 95 880           | 0,00              |
| 100 000 3.168% Novant Health Inc 01/11/2051                             | 72 145           | 0,00              | 50 000 3.400% NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 01/05/2030         | 44 953           | 0,00              |
| 50 000 3.400% Novartis Capital Corp 06/05/2024                          | 49 366           | 0,00              | 50 000 2.500% NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 11/05/2031         | 41 350           | 0,00              |
| 50 000 1.750% Novartis Capital Corp 14/02/2025                          | 47 685           | 0,00              | 100 000 3.250% NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 11/05/2041        | 72 689           | 0,00              |
| 200 000 3.000% Novartis Capital Corp 20/11/2025                         | 194 244          | 0,01              | 50 000 5.750% NYU Langone Hospitals 01/07/2043                          | 53 467           | 0,00              |
| 150 000 2.000% Novartis Capital Corp 14/02/2027                         | 138 489          | 0,01              | 100 000 4.368% NYU Langone Hospitals 01/07/2047                         | 90 306           | 0,00              |
| 150 000 3.100% Novartis Capital Corp 17/05/2027                         | 144 277          | 0,01              | 100 000 0.500% Oesterreichische Kontrollbank AG 16/09/2024              | 94 549           | 0,00              |
| 50 000 4.000% Novartis Capital Corp 20/11/2045                          | 46 013           | 0,00              | 150 000 1.500% Oesterreichische Kontrollbank AG 12/02/2025              | 142 666          | 0,01              |
| 50 000 2.000% NRG Energy Inc 02/12/2025                                 | 45 026           | 0,00              | 50 000 0.375% Oesterreichische Kontrollbank AG 17/09/2025               | 45 748           | 0,00              |
| 82 000 2.450% NRG Energy Inc 02/12/2027                                 | 70 349           | 0,00              | 100 000 4.625% Oesterreichische Kontrollbank AG 03/11/2025              | 101 409          | 0,01              |
| 100 000 1.875% NRW Bank 31/07/2024                                      | 96 606           | 0,00              | 350 000 0.500% Oesterreichische Kontrollbank AG 02/02/2026              | 317 271          | 0,01              |
| 400 000 0.375% NRW Bank 10/02/2025                                      | 372 540          | 0,02              | 100 000 5.950% Oglethorpe Power Corp 01/11/2039                         | 102 275          | 0,01              |
| 100 000 0.625% NRW Bank 19/05/2025                                      | 92 753           | 0,00              | 50 000 2.600% Ohio Power Co 01/04/2030                                  | 43 490           | 0,00              |
| 100 000 4.625% NRW Bank 04/11/2025                                      | 101 101          | 0,01              | 50 000 4.000% Ohio Power Co 01/06/2049                                  | 41 719           | 0,00              |
| 100 000 3.200% NSTAR Electric Co 15/05/2027                             | 95 048           | 0,00              | 100 000 2.900% Ohio Power Co 01/10/2051                                 | 68 018           | 0,00              |
| 50 000 3.950% NSTAR Electric Co 01/04/2030                              | 48 424           | 0,00              | 100 000 3.042% OhioHealth Corp 15/11/2050                               | 72 386           | 0,00              |
| 50 000 5.500% NSTAR Electric Co 15/03/2040                              | 52 338           | 0,00              | 50 000 3.875% Old Republic International Corp 26/08/2026                | 47 810           | 0,00              |
| 50 000 3.100% NSTAR Electric Co 01/06/2051                              | 35 665           | 0,00              | 100 000 4.750% Omega Healthcare Investors Inc 15/01/2028                | 92 674           | 0,00              |
| 200 000 4.239% NTT Finance Corp 25/07/2025                              | 197 216          | 0,01              | 100 000 3.625% Omega Healthcare Investors Inc 01/10/2029                | 83 958           | 0,00              |
| 200 000 1.162% NTT Finance Corp 03/04/2026                              | 180 594          | 0,01              | 50 000 3.375% Omega Healthcare Investors Inc 01/02/2031                 | 39 774           | 0,00              |
| 200 000 1.591% NTT Finance Corp 03/04/2028                              | 172 722          | 0,01              | 100 000 2.450% Omnicom Group Inc 30/04/2030                             | 85 564           | 0,00              |
| 200 000 2.065% NTT Finance Corp 03/04/2031                              | 166 880          | 0,01              | 100 000 4.200% Omnicom Group Inc 01/06/2030                             | 96 145           | 0,00              |
| 100 000 4.300% Nucor Corp 23/05/2027                                    | 98 206           | 0,01              | 150 000 2.750% Oncor Electric Delivery Co LLC 15/05/2030                | 133 854          | 0,01              |
| 50 000 3.950% Nucor Corp 01/05/2028                                     | 48 212           | 0,00              | 50 000 4.550% Oncor Electric Delivery Co LLC 15/09/2032                 | 49 795           | 0,00              |
| 150 000 3.125% Nucor Corp 01/04/2032                                    | 132 460          | 0,01              | 50 000 4.550% Oncor Electric Delivery Co LLC 01/12/2041                 | 47 368           | 0,00              |
| 75 000 4.400% Nucor Corp 01/05/2048                                     | 66 165           | 0,00              | 50 000 4.100% Oncor Electric Delivery Co LLC 15/11/2048                 | 43 808           | 0,00              |
| 25 000 4.125% Nutrien Ltd 15/03/2035                                    | 22 425           | 0,00              | 100 000 3.100% Oncor Electric Delivery Co LLC 15/09/2049                | 73 082           | 0,00              |
| 25 000 5.875% Nutrien Ltd 01/12/2036                                    | 26 097           | 0,00              | 100 000 4.950% Oncor Electric Delivery Co LLC 15/09/2052                | 98 944           | 0,01              |
| 100 000 5.625% Nutrien Ltd 01/12/2040                                   | 99 747           | 0,01              |   |                  |                   |
| 50 000 4.125% Nuveen Finance LLC 01/11/2024                             | 48 980           | 0,00              |   |                  |                   |
| 50 000 3.200% NVIDIA Corp 16/09/2026                                    | 48 624           | 0,00              |   |                  |                   |
| 100 000 1.550% NVIDIA Corp 15/06/2028                                   | 88 139           | 0,00              |   |                  |                   |
| 150 000 2.850% NVIDIA Corp 01/04/2030                                   | 136 530          | 0,01              |   |                  |                   |
| 50 000 3.500% NVIDIA Corp 01/04/2040                                    | 42 880           | 0,00              |   |                  |                   |
| 50 000 3.500% NVIDIA Corp 01/04/2050                                    | 40 957           | 0,00              |   |                  |                   |
| 50 000 3.000% NVR Inc 15/05/2030  | 44 032           | 0,00              |   |                  |                   |
| 50 000 5.550% NXP BV / NXP Funding LLC 01/12/2028                       | 51 091           | 0,00              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>              |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>        |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                                      |                  |                   |
| 50 000 4.000% ONEOK Inc 13/07/2027   | 47 792           | 0,00              |
| 200 000 3.100% ONEOK Inc 15/03/2030  | 175 124          | 0,01              |
| 200 000 6.100% ONEOK Inc 15/11/2032  | 207 128          | 0,01              |
| 200 000 6.125% ONEOK Partners LP 01/02/2041                                    | 197 074          | 0,01              |
| 50 000 6.200% ONEOK Partners LP 15/09/2043                                     | 49 461           | 0,00              |
| 200 000 4.125% Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust 01/02/2029 | 185 736          | 0,01              |
| 200 000 2.500% Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust 15/10/2031 | 157 330          | 0,01              |
| 50 000 6.900% Open Text Corp 01/12/2027  | 51 550           | 0,00              |
| 200 000 2.950% Oracle Corp 15/11/2024  | 194 326          | 0,01              |
| 200 000 2.500% Oracle Corp 01/04/2025  | 191 334          | 0,01              |
| 100 000 5.800% Oracle Corp 10/11/2025  | 102 497          | 0,01              |
| 100 000 1.650% Oracle Corp 25/03/2026  | 91 877           | 0,00              |
| 50 000 2.650% Oracle Corp 15/07/2026   | 46 717           | 0,00              |
| 100 000 2.300% Oracle Corp 25/03/2028  | 89 491           | 0,00              |
| 100 000 6.150% Oracle Corp 09/11/2029  | 106 532          | 0,01              |
| 200 000 2.950% Oracle Corp 01/04/2030  | 176 570          | 0,01              |
| 400 000 2.875% Oracle Corp 25/03/2031  | 342 296          | 0,01              |
| 100 000 6.250% Oracle Corp 09/11/2032  | 107 338          | 0,01              |
| 100 000 4.300% Oracle Corp 08/07/2034  | 91 382           | 0,00              |
| 50 000 3.900% Oracle Corp 15/05/2035   | 43 711           | 0,00              |
| 50 000 3.850% Oracle Corp 15/07/2036   | 42 511           | 0,00              |
| 200 000 3.800% Oracle Corp 15/11/2037  | 166 352          | 0,01              |
| 50 000 6.125% Oracle Corp 08/07/2039   | 52 120           | 0,00              |
| 150 000 3.600% Oracle Corp 01/04/2040  | 116 233          | 0,01              |
| 100 000 3.650% Oracle Corp 25/03/2041  | 77 442           | 0,00              |
| 100 000 4.000% Oracle Corp 15/07/2046  | 76 498           | 0,00              |
| 50 000 4.000% Oracle Corp 15/11/2047   | 38 164           | 0,00              |
| 200 000 3.600% Oracle Corp 01/04/2050  | 141 658          | 0,01              |
| 200 000 3.950% Oracle Corp 25/03/2051  | 150 248          | 0,01              |
| 150 000 6.900% Oracle Corp 09/11/2052  | 168 139          | 0,01              |
| 200 000 3.850% Oracle Corp 01/04/2060  | 139 536          | 0,01              |
| 100 000 4.100% Oracle Corp 25/03/2061  | 73 382           | 0,00              |
| 50 000 5.500% Orange SA 06/02/2044   | 52 673           | 0,00              |
| 50 000 3.900% O'Reilly Automotive Inc 01/06/2029                               | 47 805           | 0,00              |
| 50 000 4.200% O'Reilly Automotive Inc 01/04/2030                               | 48 100           | 0,00              |
| 50 000 5.000% ORIX Corp 13/09/2027   | 49 953           | 0,00              |
| 50 000 4.089% Orlando Health Obligated Group 01/10/2048                        | 41 764           | 0,00              |
| 50 000 4.600% Oshkosh Corp 15/05/2028  | 49 398           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 2.056% Otis Worldwide Corp 05/04/2025                           | 94 467           | 0,00              |
| 100 000 2.565% Otis Worldwide Corp 15/02/2030                           | 87 708           | 0,00              |
| 50 000 6.500% Ovirtiv Inc 15/08/2034                                    | 50 495           | 0,00              |
| 50 000 3.400% Owens Corning 15/08/2026                                  | 47 605           | 0,00              |
| 100 000 4.300% Owens Corning 15/07/2047                                 | 82 499           | 0,00              |
| 100 000 4.250% Owl Rock Capital Corp 15/01/2026                         | 91 938           | 0,00              |
| 200 000 2.625% Owl Rock Capital Corp 15/01/2027                         | 169 330          | 0,01              |
| 50 000 3.125% OWL Rock Core Income Corp 23/09/2026                      | 42 645           | 0,00              |
| 200 000 3.550% PACCAR Financial Corp 11/08/2025                         | 196 086          | 0,01              |
| 100 000 3.150% Pacific Gas and Electric Co 01/01/2026                   | 93 266           | 0,00              |
| 100 000 5.450% Pacific Gas and Electric Co 15/06/2027                   | 98 964           | 0,01              |
| 150 000 4.550% Pacific Gas and Electric Co 01/07/2030                   | 140 238          | 0,01              |
| 200 000 2.500% Pacific Gas and Electric Co 01/02/2031                   | 161 870          | 0,01              |
| 50 000 4.500% Pacific Gas and Electric Co 01/07/2040                    | 41 148           | 0,00              |
| 200 000 4.200% Pacific Gas and Electric Co 01/06/2041                   | 157 706          | 0,01              |
| 50 000 3.500% Pacific Gas and Electric Co 01/08/2050                    | 33 015           | 0,00              |
| 150 000 1.200% Pacific Life Global Funding II 24/06/2025                | 137 698          | 0,01              |
| 50 000 1.375% Pacific Life Global Funding II 14/04/2026                 | 44 953           | 0,00              |
| 100 000 1.450% Pacific Life Global Funding II 20/01/2028                | 84 015           | 0,00              |
| 50 000 2.450% Pacific Life Global Funding II 11/01/2032                 | 40 861           | 0,00              |
| 200 000 4.750% Pacific National Finance Pty Ltd 22/03/2028              | 187 120          | 0,01              |
| 50 000 3.500% PacifiCorp 15/06/2029                                     | 47 094           | 0,00              |
| 100 000 6.350% PacifiCorp 15/07/2038                                    | 114 519          | 0,01              |
| 200 000 6.000% PacifiCorp 15/01/2039                                    | 217 670          | 0,01              |
| 100 000 2.900% PacifiCorp 15/06/2052                                    | 68 643           | 0,00              |
| 100 000 5.350% PacifiCorp 01/12/2053                                    | 102 611          | 0,01              |
| 150 000 3.000% Packaging Corp of America 15/12/2029                     | 134 881          | 0,01              |
| 50 000 3.050% Packaging Corp of America 01/10/2051                      | 34 092           | 0,00              |
| 250 000 3.113% Panasonic Holdings Corp 19/07/2029                       | 226 867          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                   |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>             |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 150 000 4.000% Paramount Global 15/01/2026                              | 145 287          | 0,01              | 50 000 3.450% PepsiCo Inc 06/10/2046  | 42 768           | 0,00              |
| 200 000 3.700% Paramount Global 01/06/2028                              | 181 406          | 0,01              | 100 000 3.375% PepsiCo Inc 29/07/2049   | 82 950           | 0,00              |
| 50 000 4.200% Paramount Global 01/06/2029                               | 45 916           | 0,00              | 100 000 2.750% PepsiCo Inc 21/10/2051   | 73 373           | 0,00              |
| 50 000 4.950% Paramount Global 15/01/2031                               | 46 101           | 0,00              | 100 000 1.900% PerkinElmer Inc 15/09/2028   | 85 670           | 0,00              |
| 50 000 4.200% Paramount Global 19/05/2032                               | 42 955           | 0,00              | 50 000 3.300% PerkinElmer Inc 15/09/2029  | 44 708           | 0,00              |
| 50 000 6.875% Paramount Global 30/04/2036                               | 51 028           | 0,00              | 150 000 1.625% Pemod Ricard International Finance LLC 01/04/2031                    | 119 761          | 0,01              |
| 50 000 4.850% Paramount Global 01/07/2042                               | 38 155           | 0,00              | 200 000 3.100% Pertamina Persero PT 21/01/2030                                      | 178 416          | 0,01              |
| 50 000 4.375% Paramount Global 15/03/2043                               | 35 516           | 0,00              | 200 000 6.500% Pertamina Persero PT 27/05/2041                                      | 208 032          | 0,01              |
| 50 000 5.250% Paramount Global 01/04/2044                               | 39 471           | 0,00              | 200 000 6.000% Pertamina Persero PT 03/05/2042                                      | 198 822          | 0,01              |
| 100 000 4.950% Paramount Global 19/05/2050                              | 74 822           | 0,00              | 200 000 4.700% Pertamina Persero PT 30/07/2049                                      | 167 656          | 0,01              |
| 50 000 3.250% Parker-Hannifin Corp 01/03/2027                           | 47 563           | 0,00              | 200 000 5.375% Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 25/01/2029 | 199 484          | 0,01              |
| 100 000 4.250% Parker-Hannifin Corp 15/09/2027                          | 98 301           | 0,01              | 200 000 4.000% Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 30/06/2050 | 144 284          | 0,01              |
| 91 000 3.250% Parker-Hannifin Corp 14/06/2029                           | 83 842           | 0,00              | 200 000 3.500% Petronas Capital Ltd 21/04/2030                                      | 187 638          | 0,01              |
| 100 000 4.500% Parker-Hannifin Corp 15/09/2029                          | 99 338           | 0,01              | 400 000 4.500% Petronas Capital Ltd 18/03/2045                                      | 374 628          | 0,02              |
| 50 000 4.450% Parker-Hannifin Corp 21/11/2044                           | 46 229           | 0,00              | 250 000 3.400% Pfizer Inc 15/05/2024  | 246 545          | 0,01              |
| 250 000 2.650% PayPal Holdings Inc 01/10/2026                           | 235 742          | 0,01              | 200 000 1.750% Pfizer Inc 18/08/2031  | 164 896          | 0,01              |
| 50 000 2.300% PayPal Holdings Inc 01/06/2030                            | 42 866           | 0,00              | 150 000 4.000% Pfizer Inc 15/12/2036  | 144 252          | 0,01              |
| 100 000 4.400% PayPal Holdings Inc 01/06/2032                           | 98 081           | 0,01              | 250 000 4.100% Pfizer Inc 15/09/2038  | 234 712          | 0,01              |
| 50 000 3.250% PayPal Holdings Inc 01/06/2050                            | 36 552           | 0,00              | 50 000 3.900% Pfizer Inc 15/03/2039   | 45 327           | 0,00              |
| 100 000 5.050% PayPal Holdings Inc 01/06/2052                           | 96 181           | 0,00              | 100 000 7.200% Pfizer Inc 15/03/2039  | 125 970          | 0,01              |
| 50 000 3.218% PeaceHealth Obligated Group 15/11/2050                    | 35 445           | 0,00              | 50 000 5.600% Pfizer Inc 15/09/2040   | 53 878           | 0,00              |
| 50 000 3.600% Pennsylvania Electric Co 01/06/2029                       | 46 640           | 0,00              | 100 000 4.300% Pfizer Inc 15/06/2043  | 94 151           | 0,00              |
| 50 000 4.000% Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp 15/07/2025  | 48 442           | 0,00              | 100 000 4.125% Pfizer Inc 15/12/2046  | 91 902           | 0,00              |
| 50 000 1.200% Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp 15/11/2025  | 44 836           | 0,00              | 50 000 4.377% PG&E Wildfire Recovery Funding LLC 03/06/2041                         | 46 559           | 0,00              |
| 50 000 4.450% Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp 29/01/2026  | 48 615           | 0,00              | 100 000 2.875% Philip Morris International Inc 01/05/2024                           | 97 848           | 0,00              |
| 100 000 1.700% Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp 15/06/2026 | 89 231           | 0,00              | 100 000 5.125% Philip Morris International Inc 15/11/2024                           | 100 751          | 0,01              |
| 50 000 4.200% Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp 01/04/2027  | 47 686           | 0,00              | 100 000 1.500% Philip Morris International Inc 01/05/2025                           | 93 604           | 0,00              |
| 200 000 2.250% PepsiCo Inc 19/03/2025                                   | 193 008          | 0,01              | 100 000 5.125% Philip Morris International Inc 17/11/2027                           | 102 367          | 0,01              |
| 350 000 2.750% PepsiCo Inc 30/04/2025                                   | 339 073          | 0,01              | 50 000 3.375% Philip Morris International Inc 15/08/2029                            | 46 311           | 0,00              |
| 50 000 2.375% PepsiCo Inc 06/10/2026                                    | 47 196           | 0,00              | 150 000 5.625% Philip Morris International Inc 17/11/2029                           | 156 777          | 0,01              |
| 50 000 2.625% PepsiCo Inc 19/03/2027                                    | 47 273           | 0,00              | 100 000 1.750% Philip Morris International Inc 01/11/2030                           | 80 493           | 0,00              |
| 100 000 3.000% PepsiCo Inc 15/10/2027                                   | 95 728           | 0,00              |   |                  |                   |
| 50 000 1.400% PepsiCo Inc 25/02/2031                                    | 41 196           | 0,00              |   |                  |                   |
| 100 000 3.900% PepsiCo Inc 18/07/2032                                   | 97 754           | 0,00              |   |                  |                   |
| 50 000 2.625% PepsiCo Inc 21/10/2041                                    | 38 662           | 0,00              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>            |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>      |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                                    |                  |                   |
| 100 000 5.750% Philip Morris International Inc 17/11/2032                    | 104 904          | 0,01              |
| 100 000 6.375% Philip Morris International Inc 16/05/2038                    | 109 343          | 0,01              |
| 100 000 4.500% Philip Morris International Inc 20/03/2042                    | 86 862           | 0,00              |
| 100 000 3.875% Philip Morris International Inc 21/08/2042                    | 79 158           | 0,00              |
| 100 000 4.125% Philip Morris International Inc 04/03/2043                    | 81 630           | 0,00              |
| 50 000 4.875% Philip Morris International Inc 15/11/2043                     | 45 286           | 0,00              |
| 50 000 3.850% Phillips 66 09/04/2025   | 48 885           | 0,00              |
| 75 000 1.300% Phillips 66 15/02/2026   | 68 053           | 0,00              |
| 200 000 2.150% Phillips 66 15/12/2030  | 165 094          | 0,01              |
| 50 000 4.650% Phillips 66 15/11/2034   | 47 930           | 0,00              |
| 100 000 4.875% Phillips 66 15/11/2044  | 93 521           | 0,00              |
| 100 000 3.300% Phillips 66 15/03/2052  | 70 815           | 0,00              |
| 100 000 3.500% Piedmont Natural Gas Co Inc 01/06/2029                        | 92 909           | 0,00              |
| 50 000 3.350% Piedmont Natural Gas Co Inc 01/06/2050                         | 35 278           | 0,00              |
| 50 000 3.150% Piedmont Operating Partnership LP 15/08/2030                   | 36 972           | 0,00              |
| 100 000 4.250% Pilgrim's Pride Corp 15/04/2031                               | 87 270           | 0,00              |
| 100 000 5.568% Pine Street Trust II 15/02/2049                               | 90 927           | 0,00              |
| 200 000 1.300% Pinnacle West Capital Corp 15/06/2025                         | 183 782          | 0,01              |
| 100 000 1.125% Pioneer Natural Resources Co 15/01/2026                       | 90 862           | 0,00              |
| 50 000 1.900% Pioneer Natural Resources Co 15/08/2030                        | 40 651           | 0,00              |
| 50 000 2.150% Pioneer Natural Resources Co 15/01/2031                        | 41 091           | 0,00              |
| 200 000 2.000% Pioneer Reward Ltd 09/04/2026                                 | 184 968          | 0,01              |
| 100 000 4.650% Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp 15/10/2025 | 99 068           | 0,01              |
| 200 000 3.550% Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp 15/12/2029 | 178 852          | 0,01              |
| 100 000 4.700% Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp 15/06/2044 | 78 195           | 0,00              |
| 250 000 4.200% PNC Bank NA 01/11/2025  | 241 950          | 0,01              |
| 50 000 3.900% PNC Financial Services Group Inc 29/04/2024                    | 48 996           | 0,00              |
| 200 000 5.671% PNC Financial Services Group Inc 28/10/2025                   | 200 038          | 0,01              |
| 100 000 5.354% PNC Financial Services Group Inc 02/12/2028                   | 100 600          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>           |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>     |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                                   |                  |                   |
| 100 000 2.550% PNC Financial Services Group Inc 22/01/2030                  | 85 300           | 0,00              |
| 200 000 6.037% PNC Financial Services Group Inc 28/10/2033                  | 210 550          | 0,01              |
| 50 000 5.068% PNC Financial Services Group Inc 24/01/2034                   | 49 364           | 0,00              |
| 250 000 3.950% Power Finance Corp Ltd 23/04/2030                            | 221 900          | 0,01              |
| 200 000 7.390% Power Sector Assets & Liabilities Management Corp 02/12/2024 | 207 490          | 0,01              |
| 150 000 3.750% PPG Industries Inc 15/03/2028                                | 144 150          | 0,01              |
| 50 000 5.000% PPL Electric Utilities Corp 15/05/2033                        | 51 083           | 0,00              |
| 50 000 3.000% PPL Electric Utilities Corp 01/10/2049                        | 36 162           | 0,00              |
| 50 000 4.375% Precision Castparts Corp 15/06/2045                           | 46 131           | 0,00              |
| 50 000 4.875% President and Fellows of Harvard College 15/10/2040           | 52 163           | 0,00              |
| 100 000 3.150% President and Fellows of Harvard College 15/07/2046          | 79 459           | 0,00              |
| 50 000 2.517% President and Fellows of Harvard College 15/10/2050           | 34 351           | 0,00              |
| 150 000 2.400% Pricoa Global Funding I 23/09/2024                           | 144 660          | 0,01              |
| 50 000 4.350% Principal Financial Group Inc 15/05/2043                      | 41 491           | 0,00              |
| 50 000 1.375% Principal Life Global Funding II 10/01/2025                   | 46 691           | 0,00              |
| 50 000 3.000% Principal Life Global Funding II 18/04/2026                   | 47 291           | 0,00              |
| 100 000 2.500% Principal Life Global Funding II 16/09/2029                  | 87 154           | 0,00              |
| 100 000 1.400% Private Export Funding Corp 15/07/2028                       | 87 276           | 0,00              |
| 50 000 1.000% Procter & Gamble Co 23/04/2026                                | 45 693           | 0,00              |
| 100 000 1.900% Procter & Gamble Co 01/02/2027                               | 92 997           | 0,00              |
| 50 000 3.000% Procter & Gamble Co 25/03/2030                                | 46 850           | 0,00              |
| 50 000 3.600% Procter & Gamble Co 25/03/2050                                | 43 431           | 0,00              |
| 50 000 2.450% Progressive Corp 15/01/2027                                   | 46 546           | 0,00              |
| 50 000 2.500% Progressive Corp 15/03/2027                                   | 46 402           | 0,00              |
| 50 000 3.200% Progressive Corp 26/03/2030                                   | 45 800           | 0,00              |
| 100 000 4.125% Progressive Corp 15/04/2047                                  | 87 441           | 0,00              |
| 50 000 4.200% Progressive Corp 15/03/2048                                   | 43 801           | 0,00              |
| 100 000 2.250% Prologis LP 15/04/2030                                       | 84 975           | 0,00              |
| 50 000 1.750% Prologis LP 01/07/2030  | 40 603           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 4.625% Prologis LP 15/01/2033                                   | 98 330           | 0,01              |
| 150 000 3.706% Prospect Capital Corp 22/01/2026                         | 132 768          | 0,01              |
| 200 000 3.257% Prosus NV 19/01/2027                                     | 181 852          | 0,01              |
| 200 000 4.027% Prosus NV 03/08/2050                                     | 131 296          | 0,01              |
| 150 000 3.218% Protective Life Global Funding 28/03/2025                | 144 412          | 0,01              |
| 150 000 1.737% Protective Life Global Funding 21/09/2030                | 118 968          | 0,01              |
| 150 000 3.744% Providence St Joseph Health Obligated Group 01/10/2047   | 119 547          | 0,01              |
| 250 000 3.125% PRUDENTIAL FDG ASIA PLC 14/04/2030                       | 220 562          | 0,01              |
| 50 000 1.500% Prudential Financial Inc 10/03/2026                       | 45 621           | 0,00              |
| 32 000 3.878% Prudential Financial Inc 27/03/2028                       | 30 946           | 0,00              |
| 100 000 2.100% Prudential Financial Inc 10/03/2030                      | 84 915           | 0,00              |
| 50 000 4.600% Prudential Financial Inc 15/05/2044                       | 45 363           | 0,00              |
| 100 000 3.935% Prudential Financial Inc 07/12/2049                      | 79 265           | 0,00              |
| 50 000 3.700% Prudential Financial Inc 13/03/2051                       | 37 863           | 0,00              |
| 100 000 5.125% Prudential Financial Inc 01/03/2052                      | 88 647           | 0,00              |
| 100 000 6.000% Prudential Financial Inc 01/09/2052                      | 93 693           | 0,00              |
| 200 000 2.125% PSA Treasury Pte Ltd 05/09/2029                          | 174 472          | 0,01              |
| 200 000 2.587% PTTEP Treasury Center Co Ltd 10/06/2027                  | 183 294          | 0,01              |
| 200 000 1.900% Public Service Co of Colorado 15/01/2031                 | 165 266          | 0,01              |
| 50 000 3.600% Public Service Co of Colorado 15/09/2042                  | 41 049           | 0,00              |
| 100 000 4.050% Public Service Co of Colorado 15/09/2049                 | 84 434           | 0,00              |
| 50 000 1.900% Public Service Electric and Gas Co 15/08/2031             | 40 703           | 0,00              |
| 100 000 3.100% Public Service Electric and Gas Co 15/03/2032            | 89 310           | 0,00              |
| 200 000 4.900% Public Service Electric and Gas Co 15/12/2032            | 204 558          | 0,01              |
| 50 000 3.650% Public Service Electric and Gas Co 01/09/2042             | 41 218           | 0,00              |
| 50 000 3.800% Public Service Electric and Gas Co 01/03/2046             | 41 187           | 0,00              |
| 50 000 3.850% Public Service Electric and Gas Co 01/05/2049             | 42 042           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 2.875% Public Service Enterprise Group Inc 15/06/2024           | 97 246           | 0,00              |
| 50 000 3.094% Public Storage 15/09/2027                                 | 47 090           | 0,00              |
| 50 000 2.750% Public Storage 01/05/2029                                 | 46 511           | 0,00              |
| 50 000 4.100% Puget Energy Inc 15/06/2030                               | 46 260           | 0,00              |
| 50 000 4.224% Puget Energy Inc 15/03/2032                               | 45 866           | 0,00              |
| 50 000 5.638% Puget Sound Energy Inc 15/04/2041                         | 51 286           | 0,00              |
| 50 000 4.300% Puget Sound Energy Inc 20/05/2045                         | 42 848           | 0,00              |
| 50 000 3.250% Puget Sound Energy Inc 15/09/2049                         | 36 671           | 0,00              |
| 200 000 5.500% PulteGroup Inc 01/03/2026                                | 200 798          | 0,01              |
| 200 000 4.625% PVH Corp 10/07/2025                                      | 195 690          | 0,01              |
| 200 000 1.375% QatarEnergy 12/09/2026                                   | 180 530          | 0,01              |
| 200 000 2.250% QatarEnergy 12/07/2031                                   | 169 750          | 0,01              |
| 200 000 3.125% QatarEnergy 12/07/2041                                   | 156 090          | 0,01              |
| 200 000 1.950% QIB Sukuk Ltd 27/10/2025                                 | 184 768          | 0,01              |
| 200 000 4.375% Qorvo Inc 15/10/2029                                     | 184 398          | 0,01              |
| 100 000 3.375% Qorvo Inc 01/04/2031                                     | 82 848           | 0,00              |
| 150 000 3.250% QUALCOMM Inc 20/05/2027                                  | 145 102          | 0,01              |
| 100 000 1.300% QUALCOMM Inc 20/05/2028                                  | 87 271           | 0,00              |
| 100 000 2.150% QUALCOMM Inc 20/05/2030                                  | 87 622           | 0,00              |
| 50 000 4.650% QUALCOMM Inc 20/05/2035                                   | 50 588           | 0,00              |
| 50 000 4.800% QUALCOMM Inc 20/05/2045                                   | 49 769           | 0,00              |
| 50 000 4.300% QUALCOMM Inc 20/05/2047                                   | 46 279           | 0,00              |
| 100 000 4.500% QUALCOMM Inc 20/05/2052                                  | 93 018           | 0,00              |
| 100 000 6.000% QUALCOMM Inc 20/05/2053                                  | 113 643          | 0,01              |
| 100 000 2.900% Quanta Services Inc 01/10/2030                           | 85 359           | 0,00              |
| 50 000 3.050% Quanta Services Inc 01/10/2041                            | 34 858           | 0,00              |
| 100 000 3.500% Quest Diagnostics Inc 30/03/2025                         | 96 928           | 0,00              |
| 82 000 3.450% Quest Diagnostics Inc 01/06/2026                          | 78 457           | 0,00              |
| 226 620 5.838% Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3 30/09/2027     | 230 359          | 0,01              |
| 50 000 4.650% Raymond James Financial Inc 01/04/2030                    | 49 342           | 0,00              |
| 100 000 4.950% Raymond James Financial Inc 15/07/2046                   | 90 798           | 0,00              |
| 100 000 2.750% Rayonier LP 17/05/2031                                   | 82 560           | 0,00              |
| 200 000 3.500% Raytheon Technologies Corp 15/03/2027                    | 193 442          | 0,01              |
| 150 000 2.250% Raytheon Technologies Corp 01/07/2030                    | 128 563          | 0,01              |
| 50 000 1.900% Raytheon Technologies Corp 01/09/2031                     | 40 820           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 4.800% Raytheon Technologies Corp 15/12/2043                     | 47 977           | 0,00              | 50 000 2.150% Rexford Industrial Realty LP 01/09/2031                   | 39 480           | 0,00              |
| 50 000 4.150% Raytheon Technologies Corp 15/05/2045                     | 43 751           | 0,00              | 200 000 5.700% Reynolds American Inc 15/08/2035                         | 188 646          | 0,01              |
| 50 000 4.050% Raytheon Technologies Corp 04/05/2047                     | 43 363           | 0,00              | 50 000 6.150% Reynolds American Inc 15/09/2043                          | 47 219           | 0,00              |
| 100 000 3.125% Raytheon Technologies Corp 01/07/2050                    | 73 754           | 0,00              | 200 000 5.850% Reynolds American Inc 15/08/2045                         | 180 308          | 0,01              |
| 100 000 3.875% Realty Income Corp 15/04/2025                            | 97 528           | 0,00              | 50 000 7.250% Rio Tinto Alcan Inc 15/03/2031                            | 58 361           | 0,00              |
| 100 000 4.875% Realty Income Corp 01/06/2026                            | 99 449           | 0,01              | 100 000 2.750% Rio Tinto Finance USA Ltd 02/11/2051                     | 69 125           | 0,00              |
| 200 000 3.000% Realty Income Corp 15/01/2027                            | 186 906          | 0,01              | 200 000 0.991% Roche Holdings Inc 05/03/2026                            | 181 656          | 0,01              |
| 50 000 3.950% Realty Income Corp 15/08/2027                             | 48 200           | 0,00              | 200 000 1.930% Roche Holdings Inc 13/12/2028                            | 176 222          | 0,01              |
| 50 000 2.200% Realty Income Corp 15/06/2028                             | 44 077           | 0,00              | 200 000 2.076% Roche Holdings Inc 13/12/2031                            | 169 204          | 0,01              |
| 50 000 4.650% Realty Income Corp 15/03/2047                             | 45 783           | 0,00              | 200 000 2.607% Roche Holdings Inc 13/12/2051                            | 139 860          | 0,01              |
| 200 000 3.875% REC Ltd 07/07/2027                                       | 187 418          | 0,01              | 100 000 3.100% Rochester Gas and Electric Corp 01/06/2027               | 93 778           | 0,00              |
| 200 000 2.750% Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 26/06/2024       | 194 964          | 0,01              | 50 000 2.492% Rockefeller Foundation 01/10/2050                         | 33 008           | 0,00              |
| 200 000 3.000% Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 26/06/2027       | 186 636          | 0,01              | 50 000 3.500% Rockwell Automation Inc 01/03/2029                        | 47 908           | 0,00              |
| 50 000 6.050% Regal Rexnord Corp 15/04/2028                             | 50 186           | 0,00              | 150 000 3.800% Rogers Communications Inc 15/03/2032                     | 134 599          | 0,01              |
| 50 000 6.300% Regal Rexnord Corp 15/02/2030                             | 50 230           | 0,00              | 50 000 4.500% Rogers Communications Inc 15/03/2042                      | 42 838           | 0,00              |
| 100 000 6.400% Regal Rexnord Corp 15/04/2033                            | 100 167          | 0,01              | 50 000 4.300% Rogers Communications Inc 15/02/2048                      | 39 752           | 0,00              |
| 50 000 2.950% Regency Centers LP 15/09/2029                             | 43 278           | 0,00              | 100 000 4.350% Rogers Communications Inc 01/05/2049                     | 81 000           | 0,00              |
| 50 000 4.400% Regency Centers LP 01/02/2047                             | 40 994           | 0,00              | 50 000 3.700% Rogers Communications Inc 15/11/2049                      | 36 649           | 0,00              |
| 50 000 1.750% Regeneron Pharmaceuticals Inc 15/09/2030                  | 40 363           | 0,00              | 100 000 4.550% Rogers Communications Inc 15/03/2052                     | 82 416           | 0,00              |
| 100 000 3.150% Reinsurance Group of America Inc 15/06/2030              | 87 749           | 0,00              | 200 000 3.250% Rongshi International Finance Ltd 21/05/2024             | 196 884          | 0,01              |
| 250 000 2.875% Reliance Industries Ltd 12/01/2032                       | 208 052          | 0,01              | 50 000 1.400% Roper Technologies Inc 15/09/2027                         | 43 372           | 0,00              |
| 70 000 2.500% Reliance Standard Life Global Funding II 30/10/2024       | 66 893           | 0,00              | 50 000 2.950% Roper Technologies Inc 15/09/2029                         | 44 882           | 0,00              |
| 100 000 1.300% Reliance Steel & Aluminum Co 15/08/2025                  | 91 876           | 0,00              | 100 000 1.750% Roper Technologies Inc 15/02/2031                        | 79 909           | 0,00              |
| 50 000 2.150% Reliance Steel & Aluminum Co 15/08/2030                   | 42 006           | 0,00              | 100 000 0.750% Royal Bank of Canada 07/10/2024                          | 93 791           | 0,00              |
| 150 000 3.000% RELX Capital Inc 22/05/2030                              | 133 488          | 0,01              | 50 000 2.250% Royal Bank of Canada 01/11/2024                           | 47 880           | 0,00              |
| 200 000 2.170% Renesas Electronics Corp 25/11/2026                      | 177 406          | 0,01              | 100 000 1.600% Royal Bank of Canada 21/01/2025                          | 94 171           | 0,00              |
| 200 000 2.500% Republic Services Inc 15/08/2024                         | 193 814          | 0,01              | 200 000 1.150% Royal Bank of Canada 10/06/2025                          | 184 056          | 0,01              |
| 50 000 2.900% Republic Services Inc 01/07/2026                          | 47 738           | 0,00              |   |                  |                   |
| 100 000 3.950% Republic Services Inc 15/05/2028                         | 97 294           | 0,00              |   |                  |                   |
| 50 000 2.300% Republic Services Inc 01/03/2030                          | 43 321           | 0,00              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>          |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>    |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                                  |                  |                   |
| 100 000 0.875% Royal Bank of Canada<br>20/01/2026                       | 90 018           | 0,00              | 50 000 4.450% Sammons Financial Group Inc<br>12/05/2027                    | 47 196           | 0,00              |
| 50 000 4.650% Royal Bank of Canada<br>27/01/2026                        | 49 275           | 0,00              | 100 000 3.350% Sammons Financial Group Inc<br>16/04/2031                   | 80 219           | 0,00              |
| 100 000 1.200% Royal Bank of Canada<br>27/04/2026                       | 89 748           | 0,00              | 50 000 3.000% San Diego Gas & Electric Co<br>15/03/2032                    | 44 154           | 0,00              |
| 200 000 2.600% Royal Bank of Canada<br>24/03/2027                       | 186 976          | 0,01              | 100 000 3.750% San Diego Gas & Electric Co<br>01/06/2047                   | 81 413           | 0,00              |
| 100 000 3.625% Royal Bank of Canada<br>04/05/2027                       | 95 820           | 0,00              | 50 000 4.100% San Diego Gas & Electric Co<br>15/06/2049                    | 42 436           | 0,00              |
| 50 000 4.240% Royal Bank of Canada<br>03/08/2027                        | 48 796           | 0,00              | 50 000 3.320% San Diego Gas & Electric Co<br>15/04/2050                    | 37 051           | 0,00              |
| 50 000 6.000% Royal Bank of Canada<br>01/11/2027                        | 52 284           | 0,00              | 100 000 2.950% San Diego Gas & Electric Co<br>15/08/2051                   | 69 624           | 0,00              |
| 100 000 3.875% Royal Bank of Canada<br>04/05/2032                       | 93 162           | 0,00              | 200 000 3.500% Santander Holdings USA Inc<br>07/06/2024                    | 194 446          | 0,01              |
| 250 000 1.750% Royalty Pharma PLC<br>02/09/2027                         | 216 700          | 0,01              | 100 000 3.450% Santander Holdings USA Inc<br>02/06/2025                    | 94 007           | 0,00              |
| 100 000 3.300% Royalty Pharma PLC<br>02/09/2040                         | 72 711           | 0,00              | 100 000 5.807% Santander Holdings USA Inc<br>09/09/2026                    | 98 194           | 0,01              |
| 100 000 3.350% Royalty Pharma PLC<br>02/09/2051                         | 65 410           | 0,00              | 200 000 2.469% Santander UK Group Holdings<br>PLC 11/01/2028               | 175 814          | 0,01              |
| 100 000 3.350% Ryder System Inc 01/09/2025                              | 95 375           | 0,00              | 200 000 3.823% Santander UK Group Holdings<br>PLC 03/11/2028               | 183 014          | 0,01              |
| 50 000 2.850% Ryder System Inc 01/03/2027                               | 45 992           | 0,00              | 200 000 5.250% Santos Finance Ltd 13/03/2029                               | 191 430          | 0,01              |
| 100 000 2.450% S&P Global Inc 01/03/2027                                | 93 966           | 0,00              | 100 000 3.649% Santos Finance Ltd 29/04/2031                               | 83 908           | 0,00              |
| 50 000 2.900% S&P Global Inc 01/03/2032                                 | 44 598           | 0,00              | 200 000 2.250% Saudi Arabian Oil Co<br>24/11/2030                          | 168 794          | 0,01              |
| 50 000 3.250% S&P Global Inc 01/12/2049                                 | 37 866           | 0,00              | 200 000 4.375% Saudi Arabian Oil Co<br>16/04/2049                          | 172 038          | 0,01              |
| 100 000 3.700% S&P Global Inc 01/03/2052                                | 82 165           | 0,00              | 200 000 3.250% Saudi Arabian Oil Co<br>24/11/2050                          | 140 548          | 0,01              |
| 100 000 4.246% Sabal Trail Transmission LLC<br>01/05/2028               | 96 647           | 0,00              | 200 000 5.060% Saudi Electricity Global Sukuk<br>Co 2 08/04/2043           | 195 166          | 0,01              |
| 50 000 4.682% Sabal Trail Transmission LLC<br>01/05/2038                | 47 713           | 0,00              | 200 000 1.740% Saudi Electricity Global Sukuk<br>Co 5 17/09/2025           | 185 372          | 0,01              |
| 100 000 5.625% Sabine Pass Liquefaction LLC<br>01/03/2025               | 100 627          | 0,01              | 200 000 2.413% Saudi Electricity Global Sukuk<br>Co 5 17/09/2030           | 173 078          | 0,01              |
| 100 000 5.875% Sabine Pass Liquefaction LLC<br>30/06/2026               | 102 034          | 0,01              | 100 000 5.125% SBL Holdings Inc 13/11/2026                                 | 90 650           | 0,00              |
| 50 000 4.200% Sabine Pass Liquefaction LLC<br>15/03/2028                | 48 055           | 0,00              | 150 000 3.500% Scentre Group Trust 1 / Scentre<br>Group Trust 2 12/02/2025 | 145 483          | 0,01              |
| 150 000 4.500% Sabine Pass Liquefaction LLC<br>15/05/2030               | 144 906          | 0,01              | 119 000 3.750% Scentre Group Trust 1 / Scentre<br>Group Trust 2 23/03/2027 | 112 157          | 0,01              |
| 50 000 3.900% Sabra Health Care LP<br>15/10/2029                        | 40 904           | 0,00              | 75 000 4.300% Schlumberger Holdings Corp<br>01/05/2029                     | 73 179           | 0,00              |
| 200 000 3.200% Sabra Health Care LP<br>01/12/2031                       | 148 194          | 0,01              | 200 000 2.650% Schlumberger Investment SA<br>26/06/2030                    | 177 090          | 0,01              |
| 200 000 0.625% Salesforce Inc 15/07/2024                                | 190 068          | 0,01              | 100 000 1.573% Sealed Air Corp 15/10/2026                                  | 87 538           | 0,00              |
| 50 000 3.700% Salesforce Inc 11/04/2028                                 | 49 109           | 0,00              | 50 000 3.250% Sempra Energy 15/06/2027                                     | 46 872           | 0,00              |
| 300 000 2.700% Salesforce Inc 15/07/2041                                | 225 018          | 0,01              | 100 000 3.800% Sempra Energy 01/02/2038                                    | 86 265           | 0,00              |
| 50 000 2.900% Salesforce Inc 15/07/2051                                 | 35 498           | 0,00              |  |                  |                   |



## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 4.125% Sempra Energy 01/04/2052                                 | 80 068           | 0,00              | 100 000 3.300% Simon Property Group LP 15/01/2026                       | 95 734           | 0,00              |
| 50 000 1.400% ServiceNow Inc 01/09/2030                                 | 40 301           | 0,00              | 50 000 3.375% Simon Property Group LP 01/12/2027                        | 46 660           | 0,00              |
| 200 000 3.250% SGSP Australia Assets Pty Ltd 29/07/2026                 | 189 066          | 0,01              | 50 000 1.750% Simon Property Group LP 01/02/2028                        | 43 065           | 0,00              |
| 100 000 2.000% Shell International Finance BV 07/11/2024                | 96 132           | 0,00              | 50 000 2.450% Simon Property Group LP 13/09/2029                        | 42 813           | 0,00              |
| 50 000 3.250% Shell International Finance BV 11/05/2025                 | 48 875           | 0,00              | 150 000 2.650% Simon Property Group LP 15/07/2030                       | 126 381          | 0,01              |
| 150 000 2.875% Shell International Finance BV 10/05/2026                | 143 688          | 0,01              | 150 000 3.250% Simon Property Group LP 13/09/2049                       | 101 640          | 0,01              |
| 100 000 3.875% Shell International Finance BV 13/11/2028                | 98 478           | 0,01              | 50 000 3.800% Simon Property Group LP 15/07/2050                        | 37 114           | 0,00              |
| 100 000 2.375% Shell International Finance BV 07/11/2029                | 88 742           | 0,00              | 200 000 2.375% SingTel Group Treasury Pte Ltd 28/08/2029                | 176 614          | 0,01              |
| 125 000 4.125% Shell International Finance BV 11/05/2035                | 119 930          | 0,01              | 200 000 2.250% Sinochem Offshore Capital Co Ltd 24/11/2026              | 180 572          | 0,01              |
| 50 000 5.500% Shell International Finance BV 25/03/2040                 | 53 124           | 0,00              | 50 000 4.250% Sinopec Capital 2013 Ltd 24/04/2043                       | 44 632           | 0,00              |
| 100 000 2.875% Shell International Finance BV 26/11/2041                | 76 467           | 0,00              | 200 000 3.250% Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd 28/04/2025   | 194 026          | 0,01              |
| 150 000 4.375% Shell International Finance BV 11/05/2045                | 138 466          | 0,01              | 200 000 3.625% Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd 12/04/2027   | 194 800          | 0,01              |
| 75 000 4.000% Shell International Finance BV 10/05/2046                 | 65 347           | 0,00              | 50 000 4.125% Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 12/09/2025    | 49 282           | 0,00              |
| 50 000 3.125% Shell International Finance BV 07/11/2049                 | 37 195           | 0,00              | 200 000 2.700% Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 13/05/2030   | 179 682          | 0,01              |
| 50 000 3.250% Shell International Finance BV 06/04/2050                 | 38 149           | 0,00              | 200 000 2.300% Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 08/01/2031   | 172 996          | 0,01              |
| 50 000 3.000% Shell International Finance BV 26/11/2051                 | 35 995           | 0,00              | 50 000 4.700% SITE Centers Corp 01/06/2027                              | 46 295           | 0,00              |
| 100 000 4.050% Sherwin-Williams Co 08/08/2024                           | 98 866           | 0,01              | 200 000 5.375% Sitios Latinoamerica SAB de CV 04/04/2032                | 179 410          | 0,01              |
| 50 000 4.250% Sherwin-Williams Co 08/08/2025                            | 49 429           | 0,00              | 200 000 2.125% SK Battery America Inc 26/01/2026                        | 176 942          | 0,01              |
| 50 000 2.300% Sherwin-Williams Co 15/05/2030                            | 42 428           | 0,00              | 200 000 3.000% SK Hynix Inc 17/09/2024                                  | 192 288          | 0,01              |
| 50 000 4.550% Sherwin-Williams Co 01/08/2045                            | 43 898           | 0,00              | 200 000 3.700% Skandinaviska Enskilda Banken AB 09/06/2025              | 193 874          | 0,01              |
| 75 000 4.500% Sherwin-Williams Co 01/06/2047                            | 66 265           | 0,00              | 200 000 3.000% Skyworks Solutions Inc 01/06/2031                        | 166 862          | 0,01              |
| 50 000 3.300% Sherwin-Williams Co 15/05/2050                            | 35 420           | 0,00              | 200 000 3.550% SMBC Aviation Capital Finance DAC 15/04/2024             | 195 094          | 0,01              |
| 200 000 4.500% Shinhan Bank Co Ltd 26/03/2028                           | 191 154          | 0,01              | 50 000 2.032% Smith & Nephew PLC 14/10/2030                             | 40 548           | 0,00              |
| 200 000 2.850% SIB Sukuk Co III Ltd 23/06/2025                          | 189 776          | 0,01              | 50 000 4.250% Smithfield Foods Inc 01/02/2027                           | 46 583           | 0,00              |
| 250 000 1.700% Siemens Financieringsmaatschappij NV 11/03/2028          | 220 230          | 0,01              | 100 000 5.200% Smithfield Foods Inc 01/04/2029                          | 93 363           | 0,00              |
| 550 000 2.875% Siemens Financieringsmaatschappij NV 11/03/2041          | 425 161          | 0,02              | 50 000 3.000% Smithfield Foods Inc 15/10/2030                           | 39 805           | 0,00              |
|   |                  |                   | 50 000 2.625% Smithfield Foods Inc 13/09/2031                           | 37 767           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 4.100% Snap-on Inc 01/03/2048                                   | 89 412           | 0,00              |
|   |                  |                   | 200 000 2.750% SNB Funding Ltd 02/10/2024                               | 192 292          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 200 000 2.625% Societe Generale SA 22/01/2025                           | 187 274          | 0,01              |
| 200 000 1.038% Societe Generale SA 18/06/2025                           | 187 352          | 0,01              |
| 200 000 1.375% Societe Generale SA 08/07/2025                           | 182 160          | 0,01              |
| 200 000 1.792% Societe Generale SA 09/06/2027                           | 173 706          | 0,01              |
| 200 000 3.000% Societe Generale SA 22/01/2030                           | 165 960          | 0,01              |
| 100 000 3.337% Societe Generale SA 21/01/2033                           | 78 502           | 0,00              |
| 200 000 4.027% Societe Generale SA 21/01/2043                           | 133 212          | 0,01              |
| 250 000 4.450% Solvay Finance America LLC 03/12/2025                    | 243 255          | 0,01              |
| 100 000 3.125% Sonoco Products Co 01/05/2030                            | 88 265           | 0,00              |
| 100 000 4.350% South32 Treasury Ltd 14/04/2032                          | 89 515           | 0,00              |
| 50 000 4.700% Southern California Edison Co 01/06/2027                  | 50 116           | 0,00              |
| 50 000 2.250% Southern California Edison Co 01/06/2030                  | 42 481           | 0,00              |
| 100 000 6.000% Southern California Edison Co 15/01/2034                 | 107 917          | 0,01              |
| 50 000 6.050% Southern California Edison Co 15/03/2039                  | 53 189           | 0,00              |
| 50 000 3.900% Southern California Edison Co 15/03/2043                  | 40 717           | 0,00              |
| 50 000 4.650% Southern California Edison Co 01/10/2043                  | 45 402           | 0,00              |
| 100 000 3.600% Southern California Edison Co 01/02/2045                 | 74 907           | 0,00              |
| 300 000 4.125% Southern California Edison Co 01/03/2048                 | 248 064          | 0,01              |
| 50 000 4.875% Southern California Edison Co 01/03/2049                  | 46 346           | 0,00              |
| 100 000 3.650% Southern California Edison Co 01/02/2050                 | 77 089           | 0,00              |
| 200 000 2.550% Southern California Gas Co 01/02/2030                    | 174 608          | 0,01              |
| 50 000 5.125% Southern California Gas Co 15/11/2040                     | 49 446           | 0,00              |
| 50 000 4.125% Southern California Gas Co 01/06/2048                     | 41 514           | 0,00              |
| 50 000 5.150% Southern Co 06/10/2025                                    | 50 603           | 0,00              |
| 200 000 3.250% Southern Co 01/07/2026                                   | 190 802          | 0,01              |
| 200 000 3.700% Southern Co 30/04/2030                                   | 187 166          | 0,01              |
| 200 000 4.400% Southern Co 01/07/2046                                   | 174 148          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>   |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>                                   |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 3.750% Southern Co 15/09/2051   | 84 457           | 0,00              |
| 50 000 1.750% Southern Co Gas Capital Corp 15/01/2031   | 39 917           | 0,00              |
| 100 000 7.500% Southern Copper Corp 27/07/2035  | 116 784          | 0,01              |
| 100 000 6.750% Southern Copper Corp 16/04/2040  | 111 912          | 0,01              |
| 50 000 5.875% Southern Copper Corp 23/04/2045   | 52 056           | 0,00              |
| 50 000 4.150% Southern Power Co 01/12/2025  | 49 044           | 0,00              |
| 100 000 5.125% Southwest Airlines Co 15/06/2027   | 99 837           | 0,01              |
| 50 000 2.625% Southwest Airlines Co 10/02/2030  | 42 515           | 0,00              |
| 100 000 2.200% Southwest Gas Corp 15/06/2030  | 82 505           | 0,00              |
| 50 000 1.650% Southwestern Electric Power Co 15/03/2026   | 45 651           | 0,00              |
| 200 000 3.250% Southwestern Electric Power Co 01/11/2051  | 139 120          | 0,01              |
| 250 000 3.375% SP Group Treasury Pte Ltd 27/02/2029   | 237 765          | 0,01              |
| 50 000 5.950% Spectra Energy Partners LP 25/09/2043   | 50 411           | 0,00              |
| 100 000 4.450% Spirit Realty LP 15/09/2026  | 95 749           | 0,00              |
| 50 000 3.200% Spirit Realty LP 15/02/2031   | 41 606           | 0,00              |
| 100 000 4.738% Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC 20/03/2025 | 99 376           | 0,01              |
| 200 000 5.152% Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC 20/09/2029 | 198 672          | 0,01              |
| 200 000 1.500% ST Engineering RHQ Ltd 29/04/2025  | 187 990          | 0,01              |
| 300 000 1.822% Standard Chartered PLC 23/11/2025  | 278 877          | 0,01              |
| 200 000 2.608% Standard Chartered PLC 12/01/2028  | 177 326          | 0,01              |
| 200 000 7.767% Standard Chartered PLC 16/11/2028  | 215 080          | 0,01              |
| 200 000 3.516% Standard Chartered PLC 12/02/2030  | 185 188          | 0,01              |
| 200 000 4.644% Standard Chartered PLC 01/04/2031  | 185 618          | 0,01              |
| 200 000 3.603% Standard Chartered PLC 12/01/2033  | 160 770          | 0,01              |
| 75 000 3.795% Stanford Health Care 15/11/2048   | 62 608           | 0,00              |
| 50 000 2.300% Stanley Black & Decker Inc 24/02/2025   | 47 687           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 3.400% Stanley Black & Decker Inc 01/03/2026                     | 47 902           | 0,00              |
| 50 000 4.250% Stanley Black & Decker Inc 15/11/2028                     | 48 305           | 0,00              |
| 100 000 2.300% Stanley Black & Decker Inc 15/03/2030                    | 83 020           | 0,00              |
| 50 000 5.200% Stanley Black & Decker Inc 01/09/2040                     | 46 874           | 0,00              |
| 100 000 2.750% Stanley Black & Decker Inc 15/11/2050                    | 59 243           | 0,00              |
| 150 000 3.800% Starbucks Corp 15/08/2025                                | 147 835          | 0,01              |
| 100 000 3.500% Starbucks Corp 01/03/2028                                | 96 163           | 0,00              |
| 100 000 2.250% Starbucks Corp 12/03/2030                                | 86 061           | 0,00              |
| 100 000 2.550% Starbucks Corp 15/11/2030                                | 86 899           | 0,00              |
| 100 000 3.000% Starbucks Corp 14/02/2032                                | 88 655           | 0,00              |
| 50 000 4.500% Starbucks Corp 15/11/2048                                 | 45 378           | 0,00              |
| 200 000 1.625% State Grid Overseas Investment BVI Ltd 05/08/2030        | 166 034          | 0,01              |
| 50 000 3.250% Steel Dynamics Inc 15/01/2031                             | 44 572           | 0,00              |
| 50 000 3.250% Steel Dynamics Inc 15/10/2050                             | 34 916           | 0,00              |
| 200 000 1.711% Stellantis Finance US Inc 29/01/2027                     | 177 190          | 0,01              |
| 200 000 2.691% Stellantis Finance US Inc 15/09/2031                     | 161 692          | 0,01              |
| 150 000 3.600% Stewart Information Services Corp 15/11/2031             | 118 033          | 0,01              |
| 50 000 4.000% Stifel Financial Corp 15/05/2030                          | 43 806           | 0,00              |
| 50 000 2.750% STORE Capital Corp 18/11/2030                             | 36 747           | 0,00              |
| 200 000 3.500% Stryker Corp 15/03/2026                                  | 194 798          | 0,01              |
| 50 000 4.625% Stryker Corp 15/03/2046                                   | 46 769           | 0,00              |
| 50 000 2.900% Stryker Corp 15/06/2050                                   | 35 533           | 0,00              |
| 200 000 1.474% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 08/07/2025           | 183 346          | 0,01              |
| 50 000 3.784% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 09/03/2026            | 48 739           | 0,00              |
| 50 000 2.632% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 14/07/2026            | 46 236           | 0,00              |
| 200 000 1.402% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 17/09/2026           | 174 882          | 0,01              |
| 200 000 2.174% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 14/01/2027           | 179 274          | 0,01              |
| 50 000 3.944% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 19/07/2028            | 47 136           | 0,00              |
| 200 000 3.040% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 16/07/2029           | 176 894          | 0,01              |
| 50 000 3.202% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 17/09/2029            | 43 692           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 200 000 2.130% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 08/07/2030           | 162 782          | 0,01              |
| 50 000 2.142% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 23/09/2030            | 39 778           | 0,00              |
| 200 000 2.222% Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 17/09/2031           | 159 556          | 0,01              |
| 200 000 4.950% Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd 15/09/2027                | 200 980          | 0,01              |
| 100 000 2.700% Sun Communities Operating LP 15/07/2031                  | 81 001           | 0,00              |
| 100 000 4.200% Sun Communities Operating LP 15/04/2032                  | 89 300           | 0,00              |
| 100 000 4.000% Suncor Energy Inc 15/11/2047                             | 79 452           | 0,00              |
| 50 000 2.294% Sutter Health 15/08/2030                                  | 42 020           | 0,00              |
| 50 000 3.361% Sutter Health 15/08/2050                                  | 36 452           | 0,00              |
| 200 000 5.750% Suzano Austria GmbH 14/07/2026                           | 200 670          | 0,01              |
| 200 000 7.000% Suzano Austria GmbH 16/03/2047                           | 206 052          | 0,01              |
| 250 000 3.650% Svenska Handelsbanken AB 10/06/2025                      | 242 182          | 0,01              |
| 250 000 3.950% Svenska Handelsbanken AB 10/06/2027                      | 240 215          | 0,01              |
| 250 000 1.418% Svenska Handelsbanken AB 11/06/2027                      | 222 212          | 0,01              |
| 400 000 3.356% Swedbank AB 04/04/2025                                   | 386 356          | 0,02              |
| 200 000 5.337% Swedbank AB 20/09/2027                                   | 199 926          | 0,01              |
| 50 000 3.625% Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 28/04/2026              | 48 075           | 0,00              |
| 150 000 4.500% Synchrony Financial 23/07/2025                           | 136 173          | 0,01              |
| 50 000 3.950% Synchrony Financial 01/12/2027                            | 42 414           | 0,00              |
| 200 000 2.875% Synchrony Financial 28/10/2031                           | 142 572          | 0,01              |
| 200 000 4.892% Syngenta Finance NV 24/04/2025                           | 195 050          | 0,01              |
| 250 000 3.750% Sysco Corp 01/10/2025                                    | 244 325          | 0,01              |
| 50 000 2.450% Sysco Corp 14/12/2031                                     | 41 680           | 0,00              |
| 50 000 3.300% Sysco Corp 15/02/2050                                     | 36 059           | 0,00              |
| 200 000 5.500% Tabreed Sukuk Spc Ltd 31/10/2025                         | 201 974          | 0,01              |
| 200 000 2.050% Takeda Pharmaceutical Co Ltd 31/03/2030                  | 168 778          | 0,01              |
| 200 000 3.375% Takeda Pharmaceutical Co Ltd 09/07/2060                  | 140 606          | 0,01              |
| 200 000 2.400% Tampa Electric Co 15/03/2031                             | 167 522          | 0,01              |
| 50 000 4.100% Tampa Electric Co 15/06/2042                              | 42 735           | 0,00              |
| 50 000 3.125% Tanger Properties LP 01/09/2026                           | 45 308           | 0,00              |
| 250 000 4.125% Tapestry Inc 15/07/2027                                  | 239 960          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                             |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>                       |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 5.200% Targa Resources Corp 01/07/2027  | 99 131           | 0,01              | 100 000 8.250% Telefonica Europe BV 15/09/2030                          | 116 844          | 0,01              |
| 100 000 4.200% Targa Resources Corp 01/02/2033  | 89 806           | 0,00              | 50 000 3.125% Telstra Corp Ltd 07/04/2025                               | 48 505           | 0,00              |
| 50 000 6.250% Targa Resources Corp 01/07/2052   | 49 359           | 0,00              | 200 000 2.800% TELUS Corp 16/02/2027                                    | 187 592          | 0,01              |
| 50 000 6.500% Targa Resources Corp 15/02/2053   | 51 187           | 0,00              | 50 000 3.400% TELUS Corp 13/05/2032                                     | 43 885           | 0,00              |
| 50 000 6.500% Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 15/07/2027  | 51 289           | 0,00              | 100 000 4.600% TELUS Corp 16/11/2048                                    | 89 003           | 0,00              |
| 100 000 4.000% Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 15/01/2032 | 87 450           | 0,00              | 50 000 4.300% TELUS Corp 15/06/2049                                     | 42 091           | 0,00              |
| 100 000 2.250% Target Corp 15/04/2025   | 96 086           | 0,00              | 250 000 2.750% Temasek Financial I Ltd 02/08/2061                       | 175 847          | 0,01              |
| 100 000 2.500% Target Corp 15/04/2026   | 95 990           | 0,00              | 200 000 3.280% Tencent Holdings Ltd 11/04/2024                          | 196 738          | 0,01              |
| 100 000 3.375% Target Corp 15/04/2029   | 95 800           | 0,00              | 200 000 2.390% Tencent Holdings Ltd 03/06/2030                          | 169 490          | 0,01              |
| 100 000 4.500% Target Corp 15/09/2032   | 100 251          | 0,01              | 200 000 3.290% Tencent Holdings Ltd 03/06/2060                          | 124 192          | 0,01              |
| 50 000 4.000% Target Corp 01/07/2042  | 45 693           | 0,00              | 100 000 7.000% Tennessee Gas Pipeline Co LLC 15/10/2028                 | 108 713          | 0,01              |
| 100 000 2.950% Target Corp 15/01/2052   | 72 341           | 0,00              | 100 000 2.900% Tennessee Gas Pipeline Co LLC 01/03/2030                 | 86 785           | 0,00              |
| 50 000 4.800% Target Corp 15/01/2053  | 49 125           | 0,00              | 50 000 7.000% Texas Eastern Transmission LP 15/07/2032                  | 57 760           | 0,00              |
| 50 000 1.750% TD SYNnex Corp 09/08/2026   | 43 554           | 0,00              | 50 000 1.375% Texas Instruments Inc 12/03/2025                          | 47 203           | 0,00              |
| 50 000 2.650% TD SYNnex Corp 09/08/2031   | 39 180           | 0,00              | 50 000 1.750% Texas Instruments Inc 04/05/2030                          | 42 391           | 0,00              |
| 100 000 4.900% Teachers Insurance & Annuity Association of America 15/09/2044                 | 91 754           | 0,00              | 100 000 3.875% Texas Instruments Inc 15/03/2039                         | 91 170           | 0,00              |
| 150 000 4.270% Teachers Insurance & Annuity Association of America 15/05/2047                 | 125 925          | 0,01              | 50 000 4.150% Texas Instruments Inc 15/05/2048                          | 46 482           | 0,00              |
| 50 000 3.300% Teachers Insurance & Annuity Association of America 15/05/2050                  | 35 687           | 0,00              | 50 000 2.450% Textron Inc 15/03/2031                                    | 42 228           | 0,00              |
| 50 000 4.375% Teachers Insurance & Annuity Association of America 15/09/2054                  | 48 579           | 0,00              | 200 000 2.500% Thaioil Treasury Center Co Ltd 18/06/2030                | 161 128          | 0,01              |
| 100 000 6.125% Teck Resources Ltd 01/10/2035  | 103 701          | 0,01              | 50 000 1.215% Thermo Fisher Scientific Inc 18/10/2024                   | 47 490           | 0,00              |
| 50 000 2.500% Teledyne FLIR LLC 01/08/2030  | 42 098           | 0,00              | 100 000 2.600% Thermo Fisher Scientific Inc 01/10/2029                  | 90 276           | 0,00              |
| 50 000 1.600% Teledyne Technologies Inc 01/04/2026  | 45 542           | 0,00              | 150 000 2.000% Thermo Fisher Scientific Inc 15/10/2031                  | 124 725          | 0,01              |
| 100 000 2.250% Teledyne Technologies Inc 01/04/2028   | 89 425           | 0,00              | 100 000 2.800% Thermo Fisher Scientific Inc 15/10/2041                  | 76 105           | 0,00              |
| 50 000 2.750% Teledyne Technologies Inc 01/04/2031  | 42 689           | 0,00              | 50 000 5.300% Thermo Fisher Scientific Inc 01/02/2044                   | 52 304           | 0,00              |
| 50 000 7.045% Telefonica Emisiones SA 20/06/2036  | 55 036           | 0,00              | 50 000 3.847% Thomas Jefferson University 01/11/2057                    | 37 513           | 0,00              |
| 150 000 4.665% Telefonica Emisiones SA 06/03/2038   | 131 502          | 0,01              | 100 000 5.850% Thomson Reuters Corp 15/04/2040                          | 99 786           | 0,01              |
| 150 000 5.213% Telefonica Emisiones SA 08/03/2047   | 131 193          | 0,01              | 200 000 2.300% Three Gorges Finance I Cayman Islands Ltd 16/10/2024     | 193 036          | 0,01              |
| 150 000 4.895% Telefonica Emisiones SA 06/03/2048   | 123 982          | 0,01              | 150 000 7.300% Time Warner Cable LLC 01/07/2038                         | 155 770          | 0,01              |
| 150 000 5.520% Telefonica Emisiones SA 01/03/2049   | 134 692          | 0,01              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 6.750% Time Warner Cable LLC<br>15/06/2039                       | 49 245           | 0,00              |
| 50 000 5.875% Time Warner Cable LLC<br>15/11/2040                       | 45 130           | 0,00              |
| 100 000 5.500% Time Warner Cable LLC<br>01/09/2041                      | 86 389           | 0,00              |
| 250 000 4.500% Time Warner Cable LLC<br>15/09/2042                      | 192 330          | 0,01              |
| 50 000 2.250% TJX Cos Inc 15/09/2026                                    | 46 964           | 0,00              |
| 200 000 3.500% T-Mobile USA Inc 15/04/2025                              | 194 464          | 0,01              |
| 100 000 1.500% T-Mobile USA Inc 15/02/2026                              | 91 406           | 0,00              |
| 50 000 2.250% T-Mobile USA Inc 15/02/2026                               | 46 597           | 0,00              |
| 250 000 2.625% T-Mobile USA Inc 15/04/2026                              | 233 990          | 0,01              |
| 50 000 5.375% T-Mobile USA Inc 15/04/2027                               | 50 236           | 0,00              |
| 200 000 2.625% T-Mobile USA Inc 15/02/2029                              | 176 396          | 0,01              |
| 150 000 2.550% T-Mobile USA Inc 15/02/2031                              | 127 068          | 0,01              |
| 150 000 2.875% T-Mobile USA Inc 15/02/2031                              | 129 363          | 0,01              |
| 100 000 3.500% T-Mobile USA Inc 15/04/2031                              | 89 927           | 0,00              |
| 50 000 2.250% T-Mobile USA Inc 15/11/2031                               | 40 930           | 0,00              |
| 200 000 2.700% T-Mobile USA Inc 15/03/2032                              | 168 436          | 0,01              |
| 100 000 5.200% T-Mobile USA Inc 15/01/2033                              | 101 775          | 0,01              |
| 150 000 3.000% T-Mobile USA Inc 15/02/2041                              | 111 063          | 0,01              |
| 150 000 4.500% T-Mobile USA Inc 15/04/2050                              | 130 227          | 0,01              |
| 200 000 3.300% T-Mobile USA Inc 15/02/2051                              | 142 212          | 0,01              |
| 100 000 3.400% T-Mobile USA Inc 15/10/2052                              | 72 016           | 0,00              |
| 100 000 5.650% T-Mobile USA Inc 15/01/2053                              | 102 441          | 0,01              |
| 100 000 5.800% T-Mobile USA Inc 15/09/2062                              | 103 246          | 0,01              |
| 200 000 5.780% TMS Issuer Sarl 23/08/2032                               | 207 994          | 0,01              |
| 200 000 4.851% TNB Global Ventures Capital<br>Bhd 01/11/2028            | 200 218          | 0,01              |
| 50 000 5.750% Toledo Hospital 15/11/2038                                | 49 063           | 0,00              |
| 150 000 4.875% Toll Brothers Finance Corp<br>15/03/2027                 | 145 848          | 0,01              |
| 50 000 2.650% Toronto-Dominion Bank<br>12/06/2024                       | 48 628           | 0,00              |
| 100 000 3.766% Toronto-Dominion Bank<br>06/06/2025                      | 97 390           | 0,00              |
| 200 000 0.750% Toronto-Dominion Bank<br>06/01/2026                      | 178 588          | 0,01              |
| 100 000 1.200% Toronto-Dominion Bank<br>03/06/2026                      | 89 076           | 0,00              |
| 100 000 2.800% Toronto-Dominion Bank<br>10/03/2027                      | 92 417           | 0,00              |
| 350 000 3.301% Toronto-Dominion Bank<br>20/04/2027                      | 335 723          | 0,01              |
| 100 000 4.108% Toronto-Dominion Bank<br>08/06/2027                      | 96 879           | 0,00              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 5.156% Toronto-Dominion Bank<br>10/01/2028                       | 50 537           | 0,00              |
| 100 000 3.625% Toronto-Dominion Bank<br>15/09/2031                      | 94 654           | 0,00              |
| 100 000 4.456% Toronto-Dominion Bank<br>08/06/2032                      | 96 880           | 0,00              |
| 150 000 2.434% TotalEnergies Capital<br>International SA 10/01/2025     | 145 155          | 0,01              |
| 100 000 2.986% TotalEnergies Capital<br>International SA 29/06/2041     | 78 138           | 0,00              |
| 100 000 3.461% TotalEnergies Capital<br>International SA 12/07/2049     | 79 282           | 0,00              |
| 200 000 3.127% TotalEnergies Capital<br>International SA 29/05/2050     | 148 286          | 0,01              |
| 50 000 3.883% TotalEnergies Capital SA<br>11/10/2028                    | 49 265           | 0,00              |
| 200 000 2.750% Tower Bersama Infrastructure<br>Tbk PT 20/01/2026        | 181 838          | 0,01              |
| 100 000 1.339% Toyota Motor Corp 25/03/2026                             | 91 374           | 0,00              |
| 50 000 0.500% Toyota Motor Credit Corp<br>18/06/2024                    | 47 580           | 0,00              |
| 100 000 0.625% Toyota Motor Credit Corp<br>13/09/2024                   | 94 495           | 0,00              |
| 100 000 4.400% Toyota Motor Credit Corp<br>20/09/2024                   | 99 807           | 0,01              |
| 100 000 1.450% Toyota Motor Credit Corp<br>13/01/2025                   | 94 686           | 0,00              |
| 50 000 1.800% Toyota Motor Credit Corp<br>13/02/2025                    | 47 607           | 0,00              |
| 100 000 3.950% Toyota Motor Credit Corp<br>30/06/2025                   | 98 766           | 0,01              |
| 50 000 5.400% Toyota Motor Credit Corp<br>10/11/2025                    | 51 305           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Toyota Motor Credit Corp<br>18/06/2026                   | 90 190           | 0,00              |
| 100 000 3.050% Toyota Motor Credit Corp<br>22/03/2027                   | 94 933           | 0,00              |
| 100 000 4.550% Toyota Motor Credit Corp<br>20/09/2027                   | 100 474          | 0,01              |
| 50 000 4.450% Toyota Motor Credit Corp<br>29/06/2029                    | 50 451           | 0,00              |
| 100 000 1.900% Toyota Motor Credit Corp<br>12/09/2031                   | 82 390           | 0,00              |
| 50 000 3.750% Trane Technologies Global<br>Holding Co Ltd 21/08/2028    | 48 413           | 0,00              |
| 50 000 5.750% Trane Technologies Global<br>Holding Co Ltd 15/06/2043    | 52 259           | 0,00              |
| 40 000 3.800% Trane Technologies<br>Luxembourg Finance SA 21/03/2029    | 37 924           | 0,00              |
| 100 000 4.250% TransCanada PipeLines Ltd<br>15/05/2028                  | 97 042           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 100 000 4.625% TransCanada PipeLines Ltd 01/03/2034   | 93 811           | 0,00              | 200 000 4.500% TSMC Arizona Corp 22/04/2052                             | 194 206          | 0,01              |
| 50 000 7.625% TransCanada PipeLines Ltd 15/01/2039  | 59 278           | 0,00              | 200 000 1.375% TSMC Global Ltd 28/09/2030                               | 159 674          | 0,01              |
| 150 000 6.100% TransCanada PipeLines Ltd 01/06/2040   | 154 491          | 0,01              | 200 000 2.250% TSMC Global Ltd 23/04/2031                               | 168 696          | 0,01              |
| 100 000 5.000% TransCanada PipeLines Ltd 16/10/2043   | 90 898           | 0,00              | 100 000 1.500% Tucson Electric Power Co 01/08/2030                      | 79 976           | 0,00              |
| 100 000 3.250% Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC 15/05/2030                                 | 90 613           | 0,00              | 50 000 3.250% Tucson Electric Power Co 15/05/2032                       | 44 719           | 0,00              |
| 50 000 4.600% Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC 15/03/2048                                  | 43 710           | 0,00              | 50 000 3.150% TWDC Enterprises 18 Corp 17/09/2025                       | 48 378           | 0,00              |
| 50 000 3.950% Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC 15/05/2050                                  | 39 787           | 0,00              | 50 000 1.850% TWDC Enterprises 18 Corp 30/07/2026                       | 46 247           | 0,00              |
| 100 000 6.250% Travelers Cos Inc 15/06/2037   | 113 230          | 0,01              | 50 000 4.125% TWDC Enterprises 18 Corp 01/12/2041                       | 45 049           | 0,00              |
| 50 000 3.750% Travelers Cos Inc 15/05/2046  | 40 775           | 0,00              | 100 000 3.000% TWDC Enterprises 18 Corp 30/07/2046                      | 73 278           | 0,00              |
| 50 000 4.050% Travelers Cos Inc 07/03/2048  | 43 153           | 0,00              | 100 000 4.000% Tyson Foods Inc 01/03/2026                               | 98 230           | 0,01              |
| 150 000 4.900% Trimble Inc 15/06/2028   | 148 849          | 0,01              | 200 000 4.350% Tyson Foods Inc 01/03/2029                               | 194 184          | 0,01              |
| 50 000 2.632% Trinity Health Corp 01/12/2040  | 36 274           | 0,00              | 100 000 5.100% Tyson Foods Inc 28/09/2048                               | 93 922           | 0,00              |
| 100 000 6.000% Tri-State Generation and Transmission Association Inc 15/06/2040                 | 97 371           | 0,00              | 200 000 0.700% UBS AG/London 09/08/2024                                 | 186 346          | 0,01              |
| 100 000 2.050% Triton Container International Ltd 15/04/2026                                    | 88 859           | 0,00              | 200 000 1.250% UBS AG/London 01/06/2026                                 | 175 636          | 0,01              |
| 50 000 3.150% Triton Container International Ltd 15/06/2031                                     | 39 628           | 0,00              | 50 000 3.426% UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C3 15/08/2050          | 46 054           | 0,00              |
| 100 000 3.250% Triton Container International Ltd / TAL International Container Corp 15/03/2032 | 79 156           | 0,00              | 300 000 4.117% UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C9 15/03/2051         | 283 703          | 0,01              |
| 50 000 4.050% Truist Bank 03/11/2025  | 48 045           | 0,00              | 200 000 1.364% UBS Group AG 30/01/2027                                  | 175 264          | 0,01              |
| 50 000 2.850% Truist Financial Corp 26/10/2024  | 47 834           | 0,00              | 200 000 1.494% UBS Group AG 10/08/2027                                  | 172 212          | 0,01              |
| 100 000 4.260% Truist Financial Corp 28/07/2026   | 96 348           | 0,00              | 200 000 4.253% UBS Group AG 23/03/2028                                  | 186 404          | 0,01              |
| 100 000 1.267% Truist Financial Corp 02/03/2027   | 87 917           | 0,00              | 200 000 2.095% UBS Group AG 11/02/2032                                  | 155 352          | 0,01              |
| 50 000 1.125% Truist Financial Corp 03/08/2027  | 42 265           | 0,00              | 200 000 4.988% UBS Group AG 05/08/2033                                  | 190 628          | 0,01              |
| 50 000 3.875% Truist Financial Corp 19/03/2029  | 45 026           | 0,00              | 50 000 3.000% UDR Inc 15/08/2031  | 42 811           | 0,00              |
| 100 000 1.887% Truist Financial Corp 07/06/2029   | 83 569           | 0,00              | 50 000 2.100% UDR Inc 15/06/2033  | 37 751           | 0,00              |
| 100 000 4.916% Truist Financial Corp 28/07/2033   | 93 204           | 0,00              | 200 000 4.625% UniCredit SpA 12/04/2027                                 | 189 322          | 0,01              |
| 50 000 5.122% Truist Financial Corp 26/01/2034  | 48 705           | 0,00              | 100 000 3.375% Unilever Capital Corp 22/03/2025                         | 97 705           | 0,00              |
| 50 000 4.061% Trustees of Boston University 01/10/2048  | 44 155           | 0,00              | 100 000 1.375% Unilever Capital Corp 14/09/2030                         | 81 473           | 0,00              |
| 110 000 5.700% Trustees of Princeton University 01/03/2039                                      | 123 656          | 0,01              | 100 000 3.500% Union Electric Co 15/03/2029                             | 94 502           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 2.150% Union Electric Co 15/03/2032                             | 81 732           | 0,00              |
|   |                  |                   | 200 000 3.900% Union Electric Co 15/09/2042                             | 168 522          | 0,01              |
|   |                  |                   | 50 000 4.000% Union Electric Co 01/04/2048                              | 41 541           | 0,00              |
|   |                  |                   | 50 000 3.750% Union Pacific Corp 15/07/2025                             | 49 271           | 0,00              |
|   |                  |                   | 50 000 2.400% Union Pacific Corp 05/02/2030                             | 44 066           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 2.375% Union Pacific Corp 20/05/2031                            | 86 368           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 2.800% Union Pacific Corp 14/02/2032                            | 87 902           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 3.600% Union Pacific Corp 15/09/2037                            | 87 793           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 3.200% Union Pacific Corp 20/05/2041                            | 80 756           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>           |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>     |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                                   |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 4.050% Union Pacific Corp 15/11/2045                                 | 43 004           | 0,00              | 50 000 6.875% UnitedHealth Group Inc 15/02/2038                         | 60 396           | 0,00              |
| 100 000 3.350% Union Pacific Corp 15/08/2046                                | 75 810           | 0,00              | 100 000 2.750% UnitedHealth Group Inc 15/05/2040                        | 75 755           | 0,00              |
| 50 000 4.000% Union Pacific Corp 15/04/2047                                 | 43 444           | 0,00              | 100 000 5.950% UnitedHealth Group Inc 15/02/2041                        | 110 318          | 0,01              |
| 100 000 3.250% Union Pacific Corp 05/02/2050                                | 76 064           | 0,00              | 50 000 4.250% UnitedHealth Group Inc 15/03/2043                         | 46 395           | 0,00              |
| 100 000 2.950% Union Pacific Corp 10/03/2052                                | 70 986           | 0,00              | 150 000 4.200% UnitedHealth Group Inc 15/01/2047                        | 133 455          | 0,01              |
| 100 000 3.500% Union Pacific Corp 14/02/2053                                | 78 908           | 0,00              | 200 000 4.250% UnitedHealth Group Inc 15/04/2047                        | 179 272          | 0,01              |
| 100 000 5.150% Union Pacific Corp 20/01/2063                                | 101 294          | 0,01              | 100 000 3.750% UnitedHealth Group Inc 15/10/2047                        | 83 848           | 0,00              |
| 50 000 3.799% Union Pacific Corp 06/04/2071                                 | 38 624           | 0,00              | 100 000 2.900% UnitedHealth Group Inc 15/05/2050                        | 70 951           | 0,00              |
| 28 909 4.300% United Airlines 2013-1 Class A Pass Through Trust 15/02/2027  | 27 626           | 0,00              | 100 000 4.750% UnitedHealth Group Inc 15/05/2052                        | 97 450           | 0,00              |
| 29 029 3.750% United Airlines 2014-2 Class A Pass Through Trust 03/03/2028  | 27 112           | 0,00              | 200 000 5.875% UnitedHealth Group Inc 15/02/2053                        | 224 800          | 0,01              |
| 39 217 3.500% United Airlines 2018-1 Class AA Pass Through Trust 01/09/2031 | 35 070           | 0,00              | 100 000 4.950% UnitedHealth Group Inc 15/05/2062                        | 97 430           | 0,00              |
| 231 000 3.750% United Overseas Bank Ltd 15/04/2029                          | 226 953          | 0,01              | 50 000 1.650% Universal Health Services Inc 01/09/2026                  | 43 688           | 0,00              |
| 200 000 3.863% United Overseas Bank Ltd 07/10/2032                          | 188 562          | 0,01              | 50 000 2.650% Universal Health Services Inc 15/10/2030                  | 40 082           | 0,00              |
| 200 000 3.900% United Parcel Service Inc 01/04/2025                         | 197 598          | 0,01              | 200 000 4.003% University of Chicago 01/10/2053                         | 172 540          | 0,01              |
| 200 000 4.450% United Parcel Service Inc 01/04/2030                         | 202 232          | 0,01              | 50 000 3.394% University of Notre Dame du Lac 15/02/2048                | 41 515           | 0,00              |
| 100 000 4.875% United Parcel Service Inc 15/11/2040                         | 100 274          | 0,01              | 50 000 3.028% University of Southern California 01/10/2039              | 41 107           | 0,00              |
| 100 000 6.000% United Rentals North America Inc 15/12/2029                  | 101 350          | 0,01              | 50 000 2.805% University of Southern California 01/10/2050              | 34 946           | 0,00              |
| 100 000 2.375% UnitedHealth Group Inc 15/08/2024                            | 97 130           | 0,00              | 100 000 4.500% Unum Group 15/12/2049                                    | 72 596           | 0,00              |
| 100 000 5.000% UnitedHealth Group Inc 15/10/2024                            | 100 788          | 0,01              | 50 000 3.600% US Bancorp 11/09/2024                                     | 48 447           | 0,00              |
| 75 000 3.750% UnitedHealth Group Inc 15/07/2025                             | 74 168           | 0,00              | 200 000 3.950% US Bancorp 17/11/2025                                    | 195 256          | 0,01              |
| 100 000 1.150% UnitedHealth Group Inc 15/05/2026                            | 91 046           | 0,00              | 150 000 3.100% US Bancorp 27/04/2026                                    | 139 197          | 0,01              |
| 50 000 3.450% UnitedHealth Group Inc 15/01/2027                             | 48 733           | 0,00              | 50 000 2.375% US Bancorp 22/07/2026                                     | 45 906           | 0,00              |
| 150 000 3.375% UnitedHealth Group Inc 15/04/2027                            | 144 417          | 0,01              | 100 000 5.727% US Bancorp 21/10/2026                                    | 100 459          | 0,01              |
| 100 000 3.875% UnitedHealth Group Inc 15/12/2028                            | 97 986           | 0,00              | 50 000 3.150% US Bancorp 27/04/2027                                     | 46 803           | 0,00              |
| 50 000 2.875% UnitedHealth Group Inc 15/08/2029                             | 45 772           | 0,00              | 100 000 4.548% US Bancorp 22/07/2028                                    | 97 342           | 0,00              |
| 100 000 5.300% UnitedHealth Group Inc 15/02/2030                            | 105 337          | 0,01              | 50 000 3.000% US Bancorp 30/07/2029                                     | 43 629           | 0,00              |
| 100 000 4.200% UnitedHealth Group Inc 15/05/2032                            | 97 863           | 0,00              | 50 000 2.677% US Bancorp 27/01/2033                                     | 41 381           | 0,00              |
| 200 000 4.625% UnitedHealth Group Inc 15/07/2035                            | 201 028          | 0,01              | 100 000 4.967% US Bancorp 22/07/2033                                    | 94 836           | 0,00              |
| 50 000 6.625% UnitedHealth Group Inc 15/11/2037                             | 58 635           | 0,00              | 100 000 5.850% US Bancorp 21/10/2033                                    | 104 491          | 0,01              |
|   |                  |                   | 50 000 4.839% US Bancorp 01/02/2034                                     | 48 473           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 5.250% Utah Acquisition Sub Inc 15/06/2046                      | 79 441           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 7.500% Valero Energy Corp 15/04/2032                             | 57 433           | 0,00              | 150 000 3.400% Verizon Communications Inc 22/03/2041                    | 119 398          | 0,01              |
| 200 000 6.625% Valero Energy Corp 15/06/2037                            | 218 686          | 0,01              | 57 000 3.850% Verizon Communications Inc 01/11/2042                     | 47 529           | 0,00              |
| 100 000 3.650% Valero Energy Corp 01/12/2051                            | 72 759           | 0,00              | 50 000 4.125% Verizon Communications Inc 15/08/2046                     | 42 789           | 0,00              |
| 50 000 4.000% Valero Energy Corp 01/06/2052                             | 38 641           | 0,00              | 100 000 4.000% Verizon Communications Inc 22/03/2050                    | 83 150           | 0,00              |
| 50 000 4.500% Valero Energy Partners LP 15/03/2028                      | 49 384           | 0,00              | 200 000 2.875% Verizon Communications Inc 20/11/2050                    | 133 478          | 0,01              |
| 250 000 5.000% Var Energi ASA 18/05/2027                                | 239 095          | 0,01              | 150 000 3.550% Verizon Communications Inc 22/03/2051                    | 114 726          | 0,01              |
| 100 000 3.500% Ventas Realty LP 01/02/2025                              | 96 304           | 0,00              | 100 000 3.875% Verizon Communications Inc 01/03/2052                    | 80 850           | 0,00              |
| 50 000 4.000% Ventas Realty LP 01/03/2028                               | 47 037           | 0,00              | 50 000 4.672% Verizon Communications Inc 15/03/2055                     | 45 235           | 0,00              |
| 50 000 3.000% Ventas Realty LP 15/01/2030                               | 43 174           | 0,00              | 50 000 2.987% Verizon Communications Inc 30/10/2056                     | 32 514           | 0,00              |
| 100 000 2.500% Ventas Realty LP 01/09/2031                              | 80 482           | 0,00              | 250 000 3.000% Verizon Communications Inc 20/11/2060                    | 160 335          | 0,01              |
| 50 000 4.875% Ventas Realty LP 15/04/2049                               | 43 414           | 0,00              | 150 000 3.700% Verizon Communications Inc 22/03/2061                    | 112 143          | 0,01              |
| 50 000 5.250% VeriSign Inc 01/04/2025                                   | 49 947           | 0,00              | 200 000 4.750% Vertex Capital Investment Ltd 03/04/2024                 | 195 660          | 0,01              |
| 100 000 2.700% VeriSign Inc 15/06/2031                                  | 85 048           | 0,00              | 50 000 2.400% VF Corp 23/04/2025  | 47 156           | 0,00              |
| 250 000 4.125% Verisk Analytics Inc 15/03/2029                          | 239 702          | 0,01              | 100 000 2.950% VF Corp 23/04/2030                                       | 84 187           | 0,00              |
| 100 000 0.850% Verizon Communications Inc 20/11/2025                    | 91 075           | 0,00              | 100 000 1.650% Viatris Inc 22/06/2025                                   | 91 864           | 0,00              |
| 100 000 1.450% Verizon Communications Inc 20/03/2026                    | 92 031           | 0,00              | 50 000 2.300% Viatris Inc 22/06/2027                                    | 43 928           | 0,00              |
| 100 000 2.625% Verizon Communications Inc 15/08/2026                    | 94 545           | 0,00              | 100 000 3.850% Viatris Inc 22/06/2040                                   | 70 263           | 0,00              |
| 200 000 4.125% Verizon Communications Inc 16/03/2027                    | 198 374          | 0,01              | 100 000 4.750% VICI Properties LP 15/02/2028                            | 95 687           | 0,00              |
| 100 000 2.100% Verizon Communications Inc 22/03/2028                    | 89 099           | 0,00              | 50 000 4.950% VICI Properties LP 15/02/2030                             | 47 253           | 0,00              |
| 200 000 4.329% Verizon Communications Inc 21/09/2028                    | 197 442          | 0,01              | 50 000 5.125% VICI Properties LP 15/05/2032                             | 47 265           | 0,00              |
| 100 000 3.875% Verizon Communications Inc 08/02/2029                    | 96 581           | 0,00              | 150 000 5.625% VICI Properties LP 15/05/2052                            | 135 055          | 0,01              |
| 100 000 3.150% Verizon Communications Inc 22/03/2030                    | 91 099           | 0,00              | 100 000 3.500% VICI Properties LP / VICI Note Co Inc 15/02/2025         | 94 743           | 0,00              |
| 50 000 1.500% Verizon Communications Inc 18/09/2030                     | 40 371           | 0,00              | 200 000 4.250% VICI Properties LP / VICI Note Co Inc 01/12/2026         | 187 372          | 0,01              |
| 50 000 1.680% Verizon Communications Inc 30/10/2030                     | 40 364           | 0,00              | 50 000 4.625% VICI Properties LP / VICI Note Co Inc 01/12/2029          | 45 938           | 0,00              |
| 100 000 1.750% Verizon Communications Inc 20/01/2031                    | 80 523           | 0,00              | 200 000 4.125% VICI Properties LP / VICI Note Co Inc 15/08/2030         | 177 712          | 0,01              |
| 250 000 2.550% Verizon Communications Inc 21/03/2031                    | 212 987          | 0,01              | 50 000 3.500% Virginia Electric and Power Co 15/03/2027                 | 48 102           | 0,00              |
| 250 000 2.355% Verizon Communications Inc 15/03/2032                    | 205 112          | 0,01              | 50 000 3.750% Virginia Electric and Power Co 15/05/2027                 | 48 570           | 0,00              |
| 200 000 4.400% Verizon Communications Inc 01/11/2034                    | 189 978          | 0,01              | 200 000 3.800% Virginia Electric and Power Co 01/04/2028                | 194 222          | 0,01              |
| 100 000 4.272% Verizon Communications Inc 15/01/2036                    | 92 915           | 0,00              | 100 000 2.300% Virginia Electric and Power Co 15/11/2031                | 83 124           | 0,00              |
| 50 000 5.250% Verizon Communications Inc 16/03/2037                     | 51 399           | 0,00              |   |                  |                   |
| 150 000 2.650% Verizon Communications Inc 20/11/2040                    | 107 131          | 0,01              |   |                  |                   |



## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 8.875% Virginia Electric and Power Co 15/11/2038                 | 69 263           | 0,00              | 100 000 4.500% Vulcan Materials Co 15/06/2047                           | 88 957           | 0,00              |
| 100 000 4.000% Virginia Electric and Power Co 15/01/2043                | 84 453           | 0,00              | 100 000 5.500% Wachovia Corp 01/08/2035                                 | 100 304          | 0,01              |
| 100 000 4.000% Virginia Electric and Power Co 15/11/2046                | 81 997           | 0,00              | 100 000 3.450% Walgreens Boots Alliance Inc 01/06/2026                  | 95 313           | 0,00              |
| 50 000 3.800% Virginia Electric and Power Co 15/09/2047                 | 39 945           | 0,00              | 50 000 3.200% Walgreens Boots Alliance Inc 15/04/2030                   | 43 935           | 0,00              |
| 200 000 3.300% Virginia Electric and Power Co 01/12/2049                | 148 210          | 0,01              | 100 000 4.100% Walgreens Boots Alliance Inc 15/04/2050                  | 74 784           | 0,00              |
| 50 000 2.450% Virginia Electric and Power Co 15/12/2050                 | 30 859           | 0,00              | 100 000 3.300% Walmart Inc 22/04/2024                                   | 99 066           | 0,01              |
| 200 000 3.150% Visa Inc 14/12/2025                                      | 194 248          | 0,01              | 50 000 2.650% Walmart Inc 15/12/2024                                    | 48 603           | 0,00              |
| 50 000 1.900% Visa Inc 15/04/2027                                       | 46 124           | 0,00              | 100 000 3.050% Walmart Inc 08/07/2026                                   | 96 918           | 0,00              |
| 150 000 2.050% Visa Inc 15/04/2030                                      | 130 945          | 0,01              | 100 000 3.250% Walmart Inc 08/07/2029                                   | 95 423           | 0,00              |
| 100 000 4.150% Visa Inc 14/12/2035                                      | 98 495           | 0,01              | 200 000 1.800% Walmart Inc 22/09/2031                                   | 169 134          | 0,01              |
| 100 000 2.700% Visa Inc 15/04/2040                                      | 79 084           | 0,00              | 200 000 2.500% Walmart Inc 22/09/2041                                   | 151 604          | 0,01              |
| 50 000 4.300% Visa Inc 14/12/2045                                       | 48 192           | 0,00              | 50 000 2.650% Walmart Inc 22/09/2051                                    | 36 065           | 0,00              |
| 100 000 3.550% Vistra Operations Co LLC 15/07/2024                      | 96 595           | 0,00              | 100 000 1.750% Walt Disney Co 30/08/2024                                | 96 241           | 0,00              |
| 50 000 3.700% Vistra Operations Co LLC 30/01/2027                       | 46 205           | 0,00              | 100 000 3.350% Walt Disney Co 24/03/2025                                | 98 242           | 0,01              |
| 150 000 4.300% Vistra Operations Co LLC 15/07/2029                      | 133 765          | 0,01              | 50 000 2.200% Walt Disney Co 13/01/2028                                 | 45 919           | 0,00              |
| 250 000 5.250% Vterra Finance BV 21/04/2032                             | 226 257          | 0,01              | 150 000 2.000% Walt Disney Co 01/09/2029                                | 130 110          | 0,01              |
| 300 000 3.900% VMware Inc 21/08/2027                                    | 287 091          | 0,01              | 150 000 3.800% Walt Disney Co 22/03/2030                                | 144 616          | 0,01              |
| 50 000 4.125% Vodafone Group PLC 30/05/2025                             | 49 440           | 0,00              | 50 000 2.650% Walt Disney Co 13/01/2031                                 | 44 128           | 0,00              |
| 100 000 4.375% Vodafone Group PLC 30/05/2028                            | 100 266          | 0,01              | 100 000 2.750% Walt Disney Co 01/09/2049                                | 69 478           | 0,00              |
| 50 000 5.000% Vodafone Group PLC 30/05/2038                             | 48 523           | 0,00              | 150 000 4.700% Walt Disney Co 23/03/2050                                | 146 632          | 0,01              |
| 200 000 5.500% Vodafone Group PLC 30/05/2048                            | 192 998          | 0,01              | 150 000 3.600% Walt Disney Co 13/01/2051                                | 121 635          | 0,01              |
| 150 000 5.125% Vodafone Group PLC 19/06/2059                            | 136 741          | 0,01              | 100 000 3.638% Warnermedia Holdings Inc 15/03/2025                      | 96 753           | 0,00              |
| 200 000 3.350% Volkswagen Group of America Finance LLC 13/05/2025       | 193 296          | 0,01              | 200 000 3.755% Warnermedia Holdings Inc 15/03/2027                      | 188 416          | 0,01              |
| 200 000 4.625% Volkswagen Group of America Finance LLC 13/11/2025       | 198 262          | 0,01              | 200 000 4.054% Warnermedia Holdings Inc 15/03/2029                      | 185 986          | 0,01              |
| 200 000 1.250% Volkswagen Group of America Finance LLC 24/11/2025       | 182 008          | 0,01              | 100 000 4.279% Warnermedia Holdings Inc 15/03/2032                      | 89 228           | 0,00              |
| 200 000 4.350% Volkswagen Group of America Finance LLC 08/06/2027       | 195 086          | 0,01              | 200 000 5.050% Warnermedia Holdings Inc 15/03/2042                      | 167 230          | 0,01              |
| 100 000 2.400% Vontier Corp 01/04/2028                                  | 84 079           | 0,00              | 250 000 5.141% Warnermedia Holdings Inc 15/03/2052                      | 202 820          | 0,01              |
| 50 000 2.950% Vontier Corp 01/04/2031                                   | 39 797           | 0,00              | 100 000 5.391% Warnermedia Holdings Inc 15/03/2062                      | 80 825           | 0,00              |
| 150 000 3.500% Vornado Realty LP 15/01/2025                             | 135 475          | 0,01              | 50 000 2.600% Waste Connections Inc 01/02/2030                          | 44 040           | 0,00              |
| 50 000 5.700% Voya Financial Inc 15/07/2043                             | 49 313           | 0,00              | 50 000 3.200% Waste Connections Inc 01/06/2032                          | 44 521           | 0,00              |
| 100 000 3.500% Vulcan Materials Co 01/06/2030                           | 91 601           | 0,00              | 50 000 4.200% Waste Connections Inc 15/01/2033                          | 47 921           | 0,00              |
|   |                  |                   | 50 000 2.950% Waste Connections Inc 15/01/2052                          | 34 665           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 1.500% Waste Management Inc 15/03/2031                          | 79 736           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>         |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>   |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                                 |                  |                   |
| 200 000 4.150% Waste Management Inc 15/04/2032                            | 193 716          | 0,01              |
| 50 000 2.500% Waste Management Inc 15/11/2050                             | 32 200           | 0,00              |
| 50 000 2.875% WEA Finance LLC 15/01/2027                                  | 43 191           | 0,00              |
| 100 000 4.125% WEA Finance LLC 20/09/2028                                 | 90 006           | 0,00              |
| 100 000 4.625% WEA Finance LLC 20/09/2048                                 | 70 830           | 0,00              |
| 200 000 5.150% WEC Energy Group Inc 01/10/2027                            | 203 750          | 0,01              |
| 175 000 1.375% WEC Energy Group Inc 15/10/2027                            | 151 833          | 0,01              |
| 149 000 3.300% Wells Fargo & Co 09/09/2024                                | 145 448          | 0,01              |
| 200 000 0.805% Wells Fargo & Co 19/05/2025                                | 190 002          | 0,01              |
| 100 000 2.406% Wells Fargo & Co 30/10/2025                                | 95 103           | 0,00              |
| 400 000 2.164% Wells Fargo & Co 11/02/2026                                | 376 792          | 0,02              |
| 50 000 3.000% Wells Fargo & Co 22/04/2026                                 | 47 250           | 0,00              |
| 200 000 2.188% Wells Fargo & Co 30/04/2026                                | 187 662          | 0,01              |
| 100 000 4.100% Wells Fargo & Co 03/06/2026                                | 96 840           | 0,00              |
| 400 000 3.196% Wells Fargo & Co 17/06/2027                                | 376 484          | 0,02              |
| 200 000 3.526% Wells Fargo & Co 24/03/2028                                | 188 690          | 0,01              |
| 75 000 3.584% Wells Fargo & Co 22/05/2028                                 | 70 633           | 0,00              |
| 100 000 2.393% Wells Fargo & Co 02/06/2028                                | 89 920           | 0,00              |
| 100 000 4.150% Wells Fargo & Co 24/01/2029                                | 95 669           | 0,00              |
| 100 000 2.879% Wells Fargo & Co 30/10/2030                                | 86 780           | 0,00              |
| 100 000 2.572% Wells Fargo & Co 11/02/2031                                | 84 846           | 0,00              |
| 100 000 3.350% Wells Fargo & Co 02/03/2033                                | 86 667           | 0,00              |
| 300 000 4.897% Wells Fargo & Co 25/07/2033                                | 292 617          | 0,01              |
| 50 000 3.068% Wells Fargo & Co 30/04/2041                                 | 37 264           | 0,00              |
| 100 000 5.375% Wells Fargo & Co 02/11/2043                                | 95 711           | 0,00              |
| 150 000 5.606% Wells Fargo & Co 15/01/2044                                | 146 302          | 0,01              |
| 250 000 3.900% Wells Fargo & Co 01/05/2045                                | 202 077          | 0,01              |
| 50 000 4.900% Wells Fargo & Co 17/11/2045                                 | 44 485           | 0,00              |
| 200 000 4.400% Wells Fargo & Co 14/06/2046                                | 164 920          | 0,01              |
| 100 000 4.750% Wells Fargo & Co 07/12/2046                                | 86 839           | 0,00              |
| 50 000 5.013% Wells Fargo & Co 04/04/2051                                 | 47 050           | 0,00              |
| 198 264 3.147% Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2014-LC18 15/12/2047 | 189 496          | 0,01              |
| 105 000 3.148% Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1 15/05/2048 | 99 799           | 0,01              |
| 72 000 3.809% Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-P2 15/12/2048    | 68 946           | 0,00              |
| 100 000 3.096% Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C34 15/06/2049  | 93 337           | 0,00              |
| 150 000 3.453% Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C38 15/07/2050  | 138 915          | 0,01              |

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>        |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                                |                  |                   |
| 125 000 4.012% Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C43 15/03/2051 | 118 279          | 0,01              |
| 200 000 4.250% Welltower OP LLC 01/04/2026                               | 196 082          | 0,01              |
| 150 000 3.100% Welltower OP LLC 15/01/2030                               | 130 773          | 0,01              |
| 100 000 6.500% Welltower OP LLC 15/03/2041                               | 104 262          | 0,01              |
| 100 000 5.150% Western & Southern Life Insurance Co 15/01/2049           | 92 639           | 0,00              |
| 100 000 4.750% Western Digital Corp 15/02/2026                           | 96 320           | 0,00              |
| 50 000 2.850% Western Digital Corp 01/02/2029                            | 40 709           | 0,00              |
| 100 000 3.100% Western Digital Corp 01/02/2032                           | 75 524           | 0,00              |
| 250 000 2.850% Western Union Co 10/01/2025                               | 238 617          | 0,01              |
| 100 000 3.450% Westinghouse Air Brake Technologies Corp 15/11/2026       | 93 992           | 0,00              |
| 50 000 4.950% Westinghouse Air Brake Technologies Corp 15/09/2028        | 49 105           | 0,00              |
| 200 000 3.600% Westlake Corp 15/08/2026                                  | 191 178          | 0,01              |
| 100 000 5.000% Westlake Corp 15/08/2046                                  | 87 040           | 0,00              |
| 50 000 4.375% Westlake Corp 15/11/2047                                   | 40 120           | 0,00              |
| 100 000 5.350% Westpac Banking Corp 18/10/2024                           | 100 797          | 0,01              |
| 100 000 2.350% Westpac Banking Corp 19/02/2025                           | 95 796           | 0,00              |
| 250 000 2.000% Westpac Banking Corp 16/01/2026                           | 238 375          | 0,01              |
| 100 000 1.150% Westpac Banking Corp 03/06/2026                           | 89 692           | 0,00              |
| 50 000 2.700% Westpac Banking Corp 19/08/2026                            | 46 963           | 0,00              |
| 50 000 3.350% Westpac Banking Corp 08/03/2027                            | 47 764           | 0,00              |
| 100 000 4.043% Westpac Banking Corp 26/08/2027                           | 98 122           | 0,01              |
| 100 000 5.457% Westpac Banking Corp 18/11/2027                           | 103 949          | 0,01              |
| 100 000 2.894% Westpac Banking Corp 04/02/2030                           | 93 899           | 0,00              |
| 100 000 4.322% Westpac Banking Corp 23/11/2031                           | 94 929           | 0,00              |
| 100 000 5.405% Westpac Banking Corp 10/08/2033                           | 95 852           | 0,00              |
| 50 000 4.110% Westpac Banking Corp 24/07/2034                            | 44 713           | 0,00              |
| 50 000 2.668% Westpac Banking Corp 15/11/2035                            | 39 007           | 0,00              |
| 100 000 4.421% Westpac Banking Corp 24/07/2039                           | 83 994           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>       |                    |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 23,46 % (mars 2022 : 24,10 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 13,97 % (suite)</b>                               |                    |                   |
| 100 000 2.963% Westpac Banking Corp 16/11/2040                          | 68 024           | 0,00              | 50 000 2.496% Yale-New Haven Health Services Corp 01/07/2050            | 31 789             | 0,00              |
| 50 000 3.133% Westpac Banking Corp 18/11/2041                           | 34 316           | 0,00              | 100 000 4.750% Yara International ASA 01/06/2028                        | 95 407             | 0,00              |
| 50 000 8.200% WestRock MWV LLC 15/01/2030                               | 58 335           | 0,00              | 200 000 2.250% Yongda Investment Ltd 16/06/2025                         | 187 438            | 0,01              |
| 50 000 4.000% Weyerhaeuser Co 15/11/2029                                | 47 140           | 0,00              | 200 000 1.980% Zhejiang Seaport International Co Ltd 17/03/2026         | 184 740            | 0,01              |
| 50 000 4.000% Weyerhaeuser Co 15/04/2030                                | 46 805           | 0,00              | 100 000 3.050% Zimmer Biomet Holdings Inc 15/01/2026                    | 95 907             | 0,00              |
| 200 000 2.375% Wharf REIC Finance BVI Ltd 07/05/2025                    | 189 324          | 0,01              | 100 000 3.000% Zoetis Inc 12/09/2027                                    | 94 716             | 0,00              |
| 50 000 4.500% Whirlpool Corp 01/06/2046                                 | 40 742           | 0,00              | 50 000 3.950% Zoetis Inc 12/09/2047                                     | 42 117             | 0,00              |
| 150 000 4.600% Whirlpool Corp 15/05/2050                                | 124 732          | 0,01              | 50 000 4.450% Zoetis Inc 20/08/2048                                     | 45 385             | 0,00              |
| 150 000 4.550% Williams Cos Inc 24/06/2024                              | 148 912          | 0,01              | 200 000 3.000% Zurich Finance Ireland Designated Activity Co 19/04/2051 | 152 436            | 0,01              |
| 100 000 2.600% Williams Cos Inc 15/03/2031                              | 83 912           | 0,00              |   | <b>371 962 762</b> | <b>13,97</b>      |
| 150 000 4.650% Williams Cos Inc 15/08/2032                              | 144 513          | 0,01              |   |                    |                   |
| 100 000 6.300% Williams Cos Inc 15/04/2040                              | 105 248          | 0,01              | <b>Total des obligations d'entreprise</b>                               | <b>624 469 812</b> | <b>23,46</b>      |
| 50 000 5.750% Williams Cos Inc 24/06/2044                               | 48 893           | 0,00              | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %)</b>               |                    |                   |
| 50 000 4.900% Williams Cos Inc 15/01/2045                               | 44 019           | 0,00              | <b>Dollar australien – 1,29 %</b>                                       |                    |                   |
| 50 000 5.100% Williams Cos Inc 15/09/2045                               | 45 899           | 0,00              | 700 000 2.750% Australia Government Bond 21/04/2024                     | 466 875            | 0,02              |
| 150 000 4.850% Williams Cos Inc 01/03/2048                              | 132 736          | 0,01              | 2 250 000 0.250% Australia Government Bond 21/11/2024                   | 1 439 849          | 0,05              |
| 50 000 3.600% Willis North America Inc 15/05/2024                       | 48 737           | 0,00              | 1 800 000 3.250% Australia Government Bond 21/04/2025                   | 1 212 506          | 0,05              |
| 50 000 2.950% Willis North America Inc 15/09/2029                       | 43 821           | 0,00              | 2 200 000 0.250% Australia Government Bond 21/11/2025                   | 1 374 715          | 0,05              |
| 100 000 5.050% Willis North America Inc 15/09/2048                      | 87 106           | 0,00              | 2 100 000 4.250% Australia Government Bond 21/04/2026                   | 1 459 542          | 0,06              |
| 50 000 4.813% Willis-Knighton Medical Center 01/09/2048                 | 44 902           | 0,00              | 2 250 000 0.500% Australia Government Bond 21/09/2026                   | 1 386 142          | 0,05              |
| 100 000 3.000% Wisconsin Power and Light Co 01/07/2029                  | 90 739           | 0,00              | 1 000 000 4.750% Australia Government Bond 21/04/2027                   | 714 590            | 0,03              |
| 100 000 3.700% Woodside Finance Ltd 15/09/2026                          | 95 837           | 0,00              | 1 900 000 2.750% Australia Government Bond 21/11/2027                   | 1 257 942          | 0,05              |
| 100 000 4.500% Woodside Finance Ltd 04/03/2029                          | 96 159           | 0,00              | 1 600 000 2.250% Australia Government Bond 21/05/2028                   | 1 031 372          | 0,04              |
| 150 000 3.500% Workday Inc 01/04/2027                                   | 143 599          | 0,01              | 2 200 000 2.750% Australia Government Bond 21/11/2028                   | 1 448 696          | 0,05              |
| 200 000 3.000% WRKCo Inc 15/06/2033                                     | 164 044          | 0,01              | 1 100 000 3.250% Australia Government Bond 21/04/2029                   | 742 612            | 0,03              |
| 200 000 2.960% Wuhan Metro Group Co Ltd 24/09/2024                      | 192 516          | 0,01              | 2 150 000 2.750% Australia Government Bond 21/11/2029                   | 1 406 383          | 0,05              |
| 50 000 3.350% Xcel Energy Inc 01/12/2026                                | 47 709           | 0,00              | 1 700 000 2.500% Australia Government Bond 21/05/2030                   | 1 089 366          | 0,04              |
| 100 000 2.600% Xcel Energy Inc 01/12/2029                               | 87 416           | 0,00              |   |                    |                   |
| 100 000 6.500% Xcel Energy Inc 01/07/2036                               | 108 969          | 0,01              |   |                    |                   |
| 200 000 4.100% Xiaomi Best Time International Ltd 14/07/2051            | 124 248          | 0,01              |   |                    |                   |
| 200 000 2.950% Xilinx Inc 01/06/2024                                    | 195 580          | 0,01              |   |                    |                   |
| 50 000 1.950% Xylem Inc/NY 30/01/2028                                   | 44 274           | 0,00              |   |                    |                   |
| 100 000 2.250% Xylem Inc/NY 30/01/2031                                  | 84 197           | 0,00              |   |                    |                   |
| 50 000 0.873% Yale University 15/04/2025                                | 46 676           | 0,00              |   |                    |                   |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar australien – 1,29 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar australien – 1,29 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 2 092 000 1.000% Australia Government Bond 21/12/2030             | 1 189 521        | 0,04              | 300 000 3.000% New South Wales Treasury Corp 20/02/2030           | 191 819          | 0,01              |
| 1 750 000 1.500% Australia Government Bond 21/06/2031             | 1 025 028        | 0,04              | 100 000 1.250% New South Wales Treasury Corp 20/11/2030           | 55 493           | 0,00              |
| 2 050 000 1.000% Australia Government Bond 21/11/2031             | 1 140 088        | 0,04              | 500 000 2.000% New South Wales Treasury Corp 20/03/2031           | 291 897          | 0,01              |
| 1 700 000 1.250% Australia Government Bond 21/05/2032             | 957 030          | 0,04              | 600 000 1.500% New South Wales Treasury Corp 20/02/2032           | 326 957          | 0,01              |
| 1 450 000 1.750% Australia Government Bond 21/11/2032             | 847 959          | 0,03              | 200 000 2.500% New South Wales Treasury Corp 22/11/2032           | 117 312          | 0,00              |
| 850 000 4.500% Australia Government Bond 21/04/2033               | 627 264          | 0,02              | 400 000 2.000% New South Wales Treasury Corp 08/03/2033           | 222 480          | 0,01              |
| 900 000 3.000% Australia Government Bond 21/11/2033               | 585 415          | 0,02              | 300 000 1.750% New South Wales Treasury Corp 20/03/2034           | 157 953          | 0,01              |
| 1 000 000 3.750% Australia Government Bond 21/05/2034             | 694 719          | 0,03              | 250 000 4.750% New South Wales Treasury Corp 20/02/2035           | 175 039          | 0,01              |
| 350 000 2.750% Australia Government Bond 21/06/2035               | 218 681          | 0,01              | 100 000 2.250% New South Wales Treasury Corp 07/05/2041           | 46 303           | 0,00              |
| 670 000 3.750% Australia Government Bond 21/04/2037               | 458 905          | 0,02              | 200 000 2.750% Northern Territory Treasury Corp 21/04/2027        | 130 161          | 0,01              |
| 425 000 3.250% Australia Government Bond 21/06/2039               | 270 597          | 0,01              | 100 000 2.500% Northern Territory Treasury Corp 21/05/2032        | 58 647           | 0,00              |
| 650 000 2.750% Australia Government Bond 21/05/2041               | 379 323          | 0,01              | 200 000 5.750% Queensland Treasury Corp 22/07/2024                | 137 865          | 0,01              |
| 580 000 3.000% Australia Government Bond 21/03/2047               | 339 156          | 0,01              | 300 000 4.750% Queensland Treasury Corp 21/07/2025                | 206 784          | 0,01              |
| 775 000 1.750% Australia Government Bond 21/06/2051               | 334 895          | 0,01              | 300 000 3.250% Queensland Treasury Corp 21/07/2026                | 199 930          | 0,01              |
| 100 000 2.500% Australian Capital Territory 22/10/2032            | 58 821           | 0,00              | 350 000 2.750% Queensland Treasury Corp 20/08/2027                | 227 933          | 0,01              |
| 225 000 3.300% BNG Bank NV 17/07/2028                             | 145 267          | 0,01              | 300 000 3.250% Queensland Treasury Corp 21/07/2028                | 198 556          | 0,01              |
| 100 000 3.300% BNG Bank NV 26/04/2029                             | 63 925           | 0,00              | 100 000 2.500% Queensland Treasury Corp 06/03/2029                | 63 068           | 0,00              |
| 100 000 3.400% Kommunalbanken AS 24/07/2028                       | 64 753           | 0,00              | 350 000 3.250% Queensland Treasury Corp 21/08/2029                | 229 591          | 0,01              |
| 100 000 3.450% Nederlandse Waterschapsbank NV 17/07/2028          | 64 981           | 0,00              | 400 000 3.500% Queensland Treasury Corp 21/08/2030                | 263 836          | 0,01              |
| 200 000 5.000% New South Wales Treasury Corp 20/08/2024           | 136 738          | 0,01              | 200 000 1.250% Queensland Treasury Corp 10/03/2031                | 110 407          | 0,00              |
| 200 000 1.250% New South Wales Treasury Corp 20/03/2025           | 128 510          | 0,01              | 400 000 1.750% Queensland Treasury Corp 21/08/2031                | 227 737          | 0,01              |
| 200 000 4.000% New South Wales Treasury Corp 20/05/2026           | 136 290          | 0,01              | 200 000 1.500% Queensland Treasury Corp 02/03/2032                | 109 469          | 0,00              |
| 400 000 3.000% New South Wales Treasury Corp 20/05/2027           | 263 442          | 0,01              | 250 000 1.500% Queensland Treasury Corp 20/08/2032                | 135 141          | 0,01              |
| 300 000 3.000% New South Wales Treasury Corp 20/03/2028           | 196 314          | 0,01              | 200 000 2.000% Queensland Treasury Corp 22/08/2033                | 110 659          | 0,00              |
| 100 000 3.000% New South Wales Treasury Corp 15/11/2028           | 65 003           | 0,00              | 300 000 1.750% Queensland Treasury Corp 20/07/2034                | 157 352          | 0,01              |
| 400 000 3.000% New South Wales Treasury Corp 20/04/2029           | 258 950          | 0,01              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>         |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>         |                  |                   |
| <b>Dollar australien – 1,29 % (suite)</b>                                 |                  |                   |
| 100 000 2.250% Queensland Treasury Corp 16/04/2040                        | 47 510           | 0,00              |
| 100 000 2.250% Queensland Treasury Corp 20/11/2041                        | 46 276           | 0,00              |
| 100 000 3.000% South Australian Government Financing Authority 20/07/2026 | 66 077           | 0,00              |
| 200 000 3.000% South Australian Government Financing Authority 24/05/2028 | 130 641          | 0,01              |
| 500 000 2.750% South Australian Government Financing Authority 24/05/2030 | 313 604          | 0,01              |
| 200 000 1.750% South Australian Government Financing Authority 24/05/2032 | 110 849          | 0,00              |
| 100 000 1.750% South Australian Government Financing Authority 24/05/2034 | 52 297           | 0,00              |
| 100 000 2.000% South Australian Government Financing Authority 23/05/2036 | 50 756           | 0,00              |
| 50 000 2.000% Tasmanian Public Finance Corp 24/01/2030                    | 29 932           | 0,00              |
| 100 000 2.250% Tasmanian Public Finance Corp 22/01/2032                   | 58 293           | 0,00              |
| 300 000 0.500% Treasury Corp of Victoria 20/11/2025                       | 186 338          | 0,01              |
| 300 000 5.500% Treasury Corp of Victoria 17/11/2026                       | 214 907          | 0,01              |
| 400 000 1.250% Treasury Corp of Victoria 19/11/2027                       | 242 511          | 0,01              |
| 500 000 3.000% Treasury Corp of Victoria 20/10/2028                       | 325 566          | 0,01              |
| 500 000 2.500% Treasury Corp of Victoria 22/10/2029                       | 312 010          | 0,01              |
| 450 000 1.500% Treasury Corp of Victoria 20/11/2030                       | 255 354          | 0,01              |
| 550 000 1.500% Treasury Corp of Victoria 10/09/2031                       | 304 286          | 0,01              |
| 300 000 2.250% Treasury Corp of Victoria 15/09/2033                       | 168 725          | 0,00              |
| 300 000 2.250% Treasury Corp of Victoria 20/11/2034                       | 163 943          | 0,01              |
| 200 000 2.000% Treasury Corp of Victoria 17/09/2035                       | 103 839          | 0,00              |
| 300 000 4.750% Treasury Corp of Victoria 15/09/2036                       | 208 247          | 0,01              |
| 100 000 2.250% Treasury Corp of Victoria 20/11/2041                       | 45 710           | 0,00              |
| 200 000 2.400% Treasury Corp of Victoria 18/08/2050                       | 84 277           | 0,00              |
| 200 000 2.500% Western Australian Treasury Corp 23/07/2024                | 132 395          | 0,01              |
| 300 000 3.000% Western Australian Treasury Corp 21/10/2026                | 198 371          | 0,01              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Dollar australien – 1,29 % (suite)</b>                         |                   |                   |
| 200 000 3.000% Western Australian Treasury Corp 21/10/2027        | 131 511           | 0,01              |
| 200 000 3.250% Western Australian Treasury Corp 20/07/2028        | 132 368           | 0,01              |
| 200 000 2.750% Western Australian Treasury Corp 24/07/2029        | 127 344           | 0,00              |
| 200 000 1.500% Western Australian Treasury Corp 22/10/2030        | 114 150           | 0,00              |
| 100 000 1.750% Western Australian Treasury Corp 22/10/2031        | 56 692            | 0,00              |
|   | <b>34 249 333</b> | <b>1,29</b>       |
| <b>Dollar canadien – 2,12 %</b>                                   |                   |                   |
| 500 000 2.900% Canada Housing Trust No 1 15/06/2024               | 363 819           | 0,01              |
| 500 000 1.800% Canada Housing Trust No 1 15/12/2024               | 356 445           | 0,01              |
| 100 000 2.550% Canada Housing Trust No 1 15/03/2025               | 72 137            | 0,00              |
| 500 000 0.950% Canada Housing Trust No 1 15/06/2025               | 347 770           | 0,01              |
| 100 000 1.950% Canada Housing Trust No 1 15/12/2025               | 70 742            | 0,00              |
| 100 000 2.250% Canada Housing Trust No 1 15/12/2025               | 71 305            | 0,00              |
| 450 000 1.250% Canada Housing Trust No 1 15/06/2026               | 310 120           | 0,01              |
| 400 000 1.900% Canada Housing Trust No 1 15/09/2026               | 280 921           | 0,01              |
| 250 000 1.100% Canada Housing Trust No 1 15/12/2026               | 170 098           | 0,01              |
| 200 000 1.550% Canada Housing Trust No 1 15/12/2026               | 138 372           | 0,01              |
| 150 000 2.350% Canada Housing Trust No 1 15/06/2027               | 106 517           | 0,00              |
| 300 000 3.800% Canada Housing Trust No 1 15/06/2027               | 225 518           | 0,01              |
| 500 000 3.600% Canada Housing Trust No 1 15/12/2027               | 374 098           | 0,01              |
| 100 000 2.350% Canada Housing Trust No 1 15/03/2028               | 70 677            | 0,00              |
| 250 000 2.650% Canada Housing Trust No 1 15/03/2028               | 179 196           | 0,01              |
| 350 000 2.650% Canada Housing Trust No 1 15/12/2028               | 249 931           | 0,01              |
| 350 000 2.100% Canada Housing Trust No 1 15/09/2029               | 240 951           | 0,01              |
| 550 000 1.750% Canada Housing Trust No 1 15/06/2030               | 366 633           | 0,01              |
| 300 000 1.100% Canada Housing Trust No 1 15/03/2031               | 188 109           | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar canadien – 2,12 % (suite)</b>                           |                  |                   | <b>Dollar canadien – 2,12 % (suite)</b>                           |                  |                   |
| 300 000 1.400% Canada Housing Trust No 1<br>15/03/2031            | 192 733          | 0,01              | 500 000 3.500% Canadian Government Bond<br>01/03/2028             | 377 338          | 0,01              |
| 250 000 1.900% Canada Housing Trust No 1<br>15/03/2031            | 167 026          | 0,01              | 1 000 000 1.750% Canadian Government Bond<br>01/06/2028           | 706 713          | 0,03              |
| 250 000 1.600% Canada Housing Trust No 1<br>15/12/2031            | 161 276          | 0,01              | 550 000 2.000% Canadian Government Bond<br>01/06/2029             | 392 159          | 0,02              |
| 250 000 2.150% Canada Housing Trust No 1<br>15/12/2031            | 168 903          | 0,01              | 500 000 2.250% Canadian Government Bond<br>01/12/2029             | 355 714          | 0,01              |
| 250 000 2.450% Canada Housing Trust No 1<br>15/12/2031            | 173 063          | 0,01              | 2 000 000 1.500% Canadian Government Bond<br>01/06/2030           | 1 324 329        | 0,05              |
| 550 000 3.550% Canada Housing Trust No 1<br>15/09/2032            | 414 173          | 0,02              | 1 650 000 0.500% Canadian Government Bond<br>01/12/2030           | 1 021 906        | 0,04              |
| 1 800 000 0.250% Canadian Government Bond<br>01/04/2024           | 1 279 279        | 0,05              | 2 250 000 1.250% Canadian Government Bond<br>01/06/2031           | 1 497 135        | 0,06              |
| 1 000 000 1.250% Canadian Government Bond<br>01/05/2024           | 718 269          | 0,03              | 1 950 000 1.500% Canadian Government Bond<br>01/12/2031           | 1 288 973        | 0,05              |
| 200 000 2.500% Canadian Government Bond<br>01/06/2024             | 145 157          | 0,01              | 1 500 000 1.750% Canadian Government Bond<br>01/06/2032           | 1 029 324        | 0,04              |
| 1 000 000 2.500% Canadian Government Bond<br>01/08/2024           | 726 730          | 0,03              | 1 450 000 2.500% Canadian Government Bond<br>01/12/2032           | 1 035 405        | 0,04              |
| 1 100 000 1.250% Canadian Government Bond<br>01/09/2024           | 785 805          | 0,03              | 400 000 5.750% Canadian Government Bond<br>01/06/2033             | 368 271          | 0,01              |
| 500 000 0.500% Canadian Government Bond<br>01/10/2024             | 352 806          | 0,01              | 1 475 000 5.000% Canadian Government Bond<br>01/06/2037           | 1 334 045        | 0,05              |
| 1 000 000 3.000% Canadian Government Bond<br>01/11/2024           | 729 043          | 0,03              | 1 800 000 4.000% Canadian Government Bond<br>01/06/2041           | 1 495 635        | 0,06              |
| 500 000 3.750% Canadian Government Bond<br>01/02/2025             | 369 516          | 0,01              | 930 000 3.500% Canadian Government Bond<br>01/12/2045             | 733 156          | 0,03              |
| 900 000 1.250% Canadian Government Bond<br>01/03/2025             | 635 796          | 0,02              | 1 200 000 2.500% Canadian Government Bond<br>01/12/2048           | 838 329          | 0,03              |
| 1 000 000 1.500% Canadian Government Bond<br>01/04/2025           | 708 442          | 0,03              | 1 525 000 2.000% Canadian Government Bond<br>01/12/2051           | 902 086          | 0,03              |
| 2 350 000 0.500% Canadian Government Bond<br>01/09/2025           | 1 615 524        | 0,06              | 1 600 000 1.750% Canadian Government Bond<br>01/12/2053           | 883 839          | 0,03              |
| 500 000 3.000% Canadian Government Bond<br>01/10/2025             | 364 998          | 0,01              | 175 000 2.750% Canadian Government Bond<br>01/12/2064             | 120 477          | 0,00              |
| 1 700 000 0.250% Canadian Government Bond<br>01/03/2026           | 1 149 131        | 0,04              | 100 000 3.000% City of Montreal Canada<br>01/09/2027              | 72 103           | 0,00              |
| 400 000 1.500% Canadian Government Bond<br>01/06/2026             | 280 551          | 0,01              | 100 000 1.750% City of Montreal Canada<br>01/09/2030              | 64 629           | 0,00              |
| 1 200 000 0.750% Canadian Government Bond<br>01/09/2026           | 823 831          | 0,03              | 100 000 3.500% City of Montreal Canada<br>01/12/2038              | 67 180           | 0,00              |
| 1 100 000 1.000% Canadian Government Bond<br>01/03/2027           | 756 422          | 0,03              | 100 000 3.050% City of Ottawa Ontario<br>10/05/2039               | 63 481           | 0,00              |
| 500 000 1.000% Canadian Government Bond<br>01/06/2027             | 340 632          | 0,01              | 200 000 2.650% City of Toronto Canada<br>09/11/2029               | 140 203          | 0,01              |
| 500 000 3.245% Canadian Government Bond<br>24/08/2027             | 371 537          | 0,01              | 250 000 3.000% CPPIB Capital Inc 15/06/2028                       | 180 702          | 0,01              |
| 750 000 2.750% Canadian Government Bond<br>01/09/2027             | 546 516          | 0,02              | 250 000 1.950% CPPIB Capital Inc 30/09/2029                       | 168 040          | 0,01              |
|   |                  |                   | 50 000 5.250% Financement-Quebec<br>01/06/2034                    | 41 507           | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 2.000% Hydro-Quebec 01/09/2028                            | 68 609           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>         |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>      |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>         |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>      |                  |                   |
| <b>Dollar canadien – 2,12 % (suite)</b>                                   |                  |                   | <b>Dollar canadien – 2,12 % (suite)</b>                                |                  |                   |
| 100 000 6.000% Hydro-Quebec 15/02/2040                                    | 90 993           | 0,00              | 100 000 4.300% Province of British Columbia Canada 18/06/2042          | 75 986           | 0,00              |
| 100 000 5.000% Hydro-Quebec 15/02/2045                                    | 82 987           | 0,00              | 300 000 2.800% Province of British Columbia Canada 18/06/2048          | 177 480          | 0,01              |
| 350 000 5.000% Hydro-Quebec 15/02/2050                                    | 298 494          | 0,01              | 400 000 2.950% Province of British Columbia Canada 18/06/2050          | 242 557          | 0,01              |
| 400 000 4.000% Hydro-Quebec 15/02/2055                                    | 294 721          | 0,01              | 300 000 2.750% Province of British Columbia Canada 18/06/2052          | 173 829          | 0,01              |
| 350 000 2.100% Hydro-Quebec 15/02/2060                                    | 164 768          | 0,01              | 100 000 2.450% Province of Manitoba Canada 02/06/2025                  | 71 806           | 0,00              |
| 150 000 4.000% Hydro-Quebec 15/02/2063                                    | 110 822          | 0,00              | 100 000 2.550% Province of Manitoba Canada 02/06/2026                  | 71 627           | 0,00              |
| 100 000 1.100% Municipal Finance Authority of British Columbia 01/06/2025 | 69 704           | 0,00              | 300 000 2.600% Province of Manitoba Canada 02/06/2027                  | 214 282          | 0,01              |
| 250 000 1.550% OMERS Finance Trust 21/04/2027                             | 170 353          | 0,01              | 200 000 3.000% Province of Manitoba Canada 02/06/2028                  | 144 663          | 0,01              |
| 200 000 2.350% Province of Alberta Canada 01/06/2025                      | 143 341          | 0,01              | 150 000 2.050% Province of Manitoba Canada 02/06/2031                  | 98 733           | 0,00              |
| 100 000 2.200% Province of Alberta Canada 01/06/2026                      | 70 874           | 0,00              | 150 000 3.900% Province of Manitoba Canada 02/12/2032                  | 112 747          | 0,00              |
| 200 000 2.550% Province of Alberta Canada 01/06/2027                      | 142 600          | 0,01              | 150 000 3.400% Province of Manitoba Canada 05/09/2048                  | 97 003           | 0,00              |
| 200 000 2.900% Province of Alberta Canada 01/12/2028                      | 143 533          | 0,01              | 200 000 3.200% Province of Manitoba Canada 05/03/2050                  | 124 788          | 0,01              |
| 400 000 2.050% Province of Alberta Canada 01/06/2030                      | 268 259          | 0,01              | 300 000 2.050% Province of Manitoba Canada 05/09/2052                  | 143 205          | 0,01              |
| 200 000 1.650% Province of Alberta Canada 01/06/2031                      | 127 649          | 0,01              | 150 000 2.350% Province of New Brunswick Canada 14/08/2027             | 105 783          | 0,00              |
| 100 000 4.150% Province of Alberta Canada 01/06/2033                      | 76 591           | 0,00              | 25 000 3.100% Province of New Brunswick Canada 14/08/2048              | 15 350           | 0,00              |
| 100 000 3.900% Province of Alberta Canada 01/12/2033                      | 74 684           | 0,00              | 200 000 3.050% Province of New Brunswick Canada 14/08/2050             | 121 354          | 0,00              |
| 50 000 3.450% Province of Alberta Canada 01/12/2043                       | 33 322           | 0,00              | 100 000 1.750% Province of Newfoundland and Labrador Canada 02/06/2030 | 65 067           | 0,00              |
| 300 000 3.300% Province of Alberta Canada 01/12/2046                      | 193 165          | 0,01              | 100 000 2.050% Province of Newfoundland and Labrador Canada 02/06/2031 | 65 142           | 0,00              |
| 450 000 3.050% Province of Alberta Canada 01/12/2048                      | 275 619          | 0,01              | 100 000 3.300% Province of Newfoundland and Labrador Canada 17/10/2046 | 61 512           | 0,00              |
| 450 000 3.100% Province of Alberta Canada 01/06/2050                      | 278 130          | 0,01              | 100 000 3.700% Province of Newfoundland and Labrador Canada 17/10/2048 | 65 800           | 0,00              |
| 250 000 2.950% Province of Alberta Canada 01/06/2052                      | 149 457          | 0,01              | 200 000 2.650% Province of Newfoundland and Labrador Canada 17/10/2050 | 106 360          | 0,00              |
| 200 000 2.850% Province of British Columbia Canada 18/06/2025             | 144 851          | 0,01              | 100 000 3.150% Province of Nova Scotia Canada 01/12/2051               | 62 038           | 0,00              |
| 100 000 2.300% Province of British Columbia Canada 18/06/2026             | 71 102           | 0,00              | 100 000 3.500% Province of Nova Scotia Canada 02/06/2062               | 65 562           | 0,00              |
| 200 000 2.550% Province of British Columbia Canada 18/06/2027             | 142 741          | 0,01              | 200 000 3.500% Province of Ontario Canada 02/06/2024                   | 146 547          | 0,01              |
| 300 000 2.950% Province of British Columbia Canada 18/12/2028             | 216 150          | 0,01              | 200 000 2.300% Province of Ontario Canada 08/09/2024                   | 144 063          | 0,01              |
| 200 000 2.200% Province of British Columbia Canada 18/06/2030             | 135 770          | 0,01              |  |                  |                   |
| 300 000 1.550% Province of British Columbia Canada 18/06/2031             | 190 312          | 0,01              |  |                  |                   |
| 150 000 3.200% Province of British Columbia Canada 18/06/2032             | 107 321          | 0,00              |  |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar canadien – 2,12 % (suite)</b>                           |                  |                   |
| 500 000 2.650% Province of Ontario Canada 05/02/2025              | 361 185          | 0,01              |
| 400 000 2.600% Province of Ontario Canada 02/06/2025              | 288 206          | 0,01              |
| 400 000 1.750% Province of Ontario Canada 08/09/2025              | 281 775          | 0,01              |
| 200 000 2.400% Province of Ontario Canada 02/06/2026              | 142 645          | 0,01              |
| 200 000 1.350% Province of Ontario Canada 08/09/2026              | 137 419          | 0,01              |
| 100 000 1.850% Province of Ontario Canada 01/02/2027              | 69 625           | 0,00              |
| 200 000 2.600% Province of Ontario Canada 02/06/2027              | 142 990          | 0,01              |
| 200 000 1.050% Province of Ontario Canada 08/09/2027              | 133 451          | 0,01              |
| 100 000 3.600% Province of Ontario Canada 08/03/2028              | 74 465           | 0,00              |
| 500 000 2.900% Province of Ontario Canada 02/06/2028              | 360 299          | 0,01              |
| 500 000 2.700% Province of Ontario Canada 02/06/2029              | 353 966          | 0,01              |
| 350 000 1.550% Province of Ontario Canada 01/11/2029              | 229 619          | 0,01              |
| 600 000 2.050% Province of Ontario Canada 02/06/2030              | 403 013          | 0,02              |
| 400 000 1.350% Province of Ontario Canada 02/12/2030              | 252 626          | 0,01              |
| 500 000 2.150% Province of Ontario Canada 02/06/2031              | 332 722          | 0,01              |
| 350 000 2.250% Province of Ontario Canada 02/12/2031              | 232 986          | 0,01              |
| 450 000 3.750% Province of Ontario Canada 02/06/2032              | 335 757          | 0,01              |
| 300 000 5.850% Province of Ontario Canada 08/03/2033              | 260 686          | 0,01              |
| 100 000 4.700% Province of Ontario Canada 02/06/2037              | 79 573           | 0,00              |
| 300 000 4.600% Province of Ontario Canada 02/06/2039              | 236 172          | 0,01              |
| 600 000 4.650% Province of Ontario Canada 02/06/2041              | 475 190          | 0,02              |
| 600 000 3.500% Province of Ontario Canada 02/06/2043              | 406 981          | 0,02              |
| 550 000 3.450% Province of Ontario Canada 02/06/2045              | 367 905          | 0,01              |
| 700 000 2.900% Province of Ontario Canada 02/12/2046              | 423 812          | 0,02              |
| 700 000 2.800% Province of Ontario Canada 02/06/2048              | 414 155          | 0,02              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar canadien – 2,12 % (suite)</b>                           |                  |                   |
| 650 000 2.900% Province of Ontario Canada 02/06/2049              | 390 226          | 0,01              |
| 700 000 2.650% Province of Ontario Canada 02/12/2050              | 398 126          | 0,02              |
| 650 000 1.900% Province of Ontario Canada 02/12/2051              | 308 259          | 0,01              |
| 450 000 2.550% Province of Ontario Canada 02/12/2052              | 248 749          | 0,01              |
| 500 000 3.750% Province of Ontario Canada 02/12/2053              | 354 180          | 0,01              |
| 200 000 3.750% Province of Quebec Canada 01/09/2024               | 147 047          | 0,01              |
| 200 000 2.600% Province of Quebec Canada 06/07/2025               | 144 029          | 0,01              |
| 400 000 2.750% Province of Quebec Canada 01/09/2025               | 288 735          | 0,01              |
| 300 000 2.500% Province of Quebec Canada 01/09/2026               | 214 457          | 0,01              |
| 200 000 2.750% Province of Quebec Canada 01/09/2027               | 143 785          | 0,01              |
| 350 000 2.750% Province of Quebec Canada 01/09/2028               | 250 042          | 0,01              |
| 450 000 2.300% Province of Quebec Canada 01/09/2029               | 310 420          | 0,01              |
| 900 000 1.900% Province of Quebec Canada 01/09/2030               | 596 054          | 0,02              |
| 500 000 1.500% Province of Quebec Canada 01/09/2031               | 314 220          | 0,01              |
| 100 000 3.650% Province of Quebec Canada 20/05/2032               | 74 206           | 0,00              |
| 350 000 3.250% Province of Quebec Canada 01/09/2032               | 250 874          | 0,01              |
| 1 000 000 3.600% Province of Quebec Canada 01/09/2033             | 734 474          | 0,03              |
| 100 000 5.000% Province of Quebec Canada 01/12/2038               | 82 167           | 0,00              |
| 100 000 5.000% Province of Quebec Canada 01/12/2041               | 82 633           | 0,00              |
| 100 000 4.250% Province of Quebec Canada 01/12/2043               | 75 370           | 0,00              |
| 450 000 3.500% Province of Quebec Canada 01/12/2045               | 302 822          | 0,01              |
| 600 000 3.500% Province of Quebec Canada 01/12/2048               | 402 530          | 0,02              |
| 750 000 3.100% Province of Quebec Canada 01/12/2051               | 467 894          | 0,02              |
| 600 000 2.850% Province of Quebec Canada 01/12/2053               | 354 334          | 0,01              |
| 350 000 4.400% Province of Quebec Canada 01/12/2055               | 278 753          | 0,01              |



## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD  | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|-------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>            |                   |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>            |                   |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar canadien – 2,12 % (suite)</b>                                      |                   |                   | <b>Couronne tchèque – 0,12 % (suite)</b>                          |                  |                   |
| 100 000 0.800% Province of Saskatchewan Canada 02/09/2025                    | 68 859            | 0,00              | 1 500 000 0.950% Czech Republic Government Bond 15/05/2030        | 53 845           | 0,00              |
| 100 000 3.050% Province of Saskatchewan Canada 02/12/2028                    | 72 321            | 0,00              | 10 000 000 5.000% Czech Republic Government Bond 30/09/2030       | 471 209          | 0,02              |
| 200 000 2.200% Province of Saskatchewan Canada 02/06/2030                    | 135 578           | 0,01              | 6 500 000 1.200% Czech Republic Government Bond 13/03/2031        | 231 879          | 0,01              |
| 100 000 2.150% Province of Saskatchewan Canada 02/06/2031                    | 66 443            | 0,00              | 5 000 000 1.750% Czech Republic Government Bond 23/06/2032        | 182 596          | 0,01              |
| 100 000 3.300% Province of Saskatchewan Canada 02/06/2048                    | 64 361            | 0,00              | 9 250 000 2.000% Czech Republic Government Bond 13/10/2033        | 336 189          | 0,01              |
| 200 000 3.100% Province of Saskatchewan Canada 02/06/2050                    | 123 842           | 0,00              | 2 000 000 3.500% Czech Republic Government Bond 30/05/2035        | 82 884           | 0,00              |
| 200 000 2.800% Province of Saskatchewan Canada 02/12/2052                    | 115 878           | 0,00              | 4 000 000 4.200% Czech Republic Government Bond 04/12/2036        | 177 066          | 0,01              |
| 150 000 3.290% PSP Capital Inc 04/04/2024                                    | 109 682           | 0,00              | 500 000 4.850% Czech Republic Government Bond 26/11/2057          | 22 841           | 0,00              |
|  | <b>56 541 976</b> | <b>2,12</b>       |   | <b>3 119 383</b> | <b>0,12</b>       |
| <b>Peso chilien – 0,05 %</b>   |                   |                   | <b>Couronne danoise – 0,16 %</b>                                  |                  |                   |
| 80 000 000 4.500% Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 01/03/2026  | 96 713            | 0,01              | 2 000 000 0.000% Denmark Government Bond 15/11/2024               | 278 560          | 0,01              |
| 200 000 000 2.300% Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 01/10/2028 | 215 173           | 0,01              | 5 000 000 1.750% Denmark Government Bond 15/11/2025               | 710 547          | 0,03              |
| 260 000 000 4.700% Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 01/09/2030 | 316 692           | 0,01              | 5 200 000 0.500% Denmark Government Bond 15/11/2027               | 690 636          | 0,03              |
| 250 000 000 5.000% Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 01/03/2035 | 313 733           | 0,01              | 4 900 000 0.500% Denmark Government Bond 15/11/2029               | 627 630          | 0,02              |
| 195 000 000 6.000% Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 01/01/2043 | 274 193           | 0,01              | 9 000 000 0.000% Denmark Government Bond 15/11/2031               | 1 061 406        | 0,03              |
|  | <b>1 216 504</b>  | <b>0,05</b>       | 4 550 000 4.500% Denmark Government Bond 15/11/2039               | 828 218          | 0,03              |
| <b>Peso colombien – 0,06 %</b>   |                   |                   | 2 500 000 0.250% Denmark Government Bond 15/11/2052               | 196 115          | 0,01              |
| 2 000 000 000 6.250% Colombian TES 26/11/2025                                | 384 340           | 0,01              |   | <b>4 393 112</b> | <b>0,16</b>       |
| 3 000 000 000 6.000% Colombian TES 28/04/2028                                | 516 560           | 0,02              | <b>Euro – 13,30 %</b>   |                  |                   |
| 3 000 000 000 7.000% Colombian TES 26/03/2031                                | 494 603           | 0,02              | 100 000 1.375% Action Logement Services 13/04/2032                | 92 914           | 0,00              |
| 1 500 000 000 7.250% Colombian TES 18/10/2034                                | 229 473           | 0,01              | 200 000 3.500% Adif Alta Velocidad 30/07/2029                     | 216 669          | 0,01              |
|  | <b>1 624 976</b>  | <b>0,06</b>       | 100 000 0.000% Agence Francaise de Developpement EPIC 25/03/2025  | 102 110          | 0,00              |
| <b>Couronne tchèque – 0,12 %</b>   |                   |                   | 200 000 1.000% Agence Francaise de Developpement EPIC 31/01/2028  | 197 297          | 0,01              |
| 3 000 000 2.400% Czech Republic Government Bond 17/09/2025                   | 129 834           | 0,01              | 100 000 0.010% Agence Francaise de Developpement EPIC 25/11/2028  | 91 414           | 0,00              |
| 8 000 000 6.000% Czech Republic Government Bond 26/02/2026                   | 379 166           | 0,01              | 100 000 2.875% Agence Francaise de Developpement EPIC 21/01/2030  | 106 951          | 0,01              |
| 3 000 000 1.000% Czech Republic Government Bond 26/06/2026                   | 122 491           | 0,01              | 100 000 0.500% Agence Francaise de Developpement EPIC 25/05/2030  | 90 678           | 0,00              |
| 3 000 000 0.250% Czech Republic Government Bond 10/02/2027                   | 116 378           | 0,00              | 100 000 0.125% Agence Francaise de Developpement EPIC 29/09/2031  | 84 317           | 0,00              |
| 9 000 000 2.500% Czech Republic Government Bond 25/08/2028                   | 371 205           | 0,01              |   |                  |                   |
| 4 100 000 2.750% Czech Republic Government Bond 23/07/2029                   | 169 160           | 0,01              |   |                  |                   |
| 8 000 000 0.050% Czech Republic Government Bond 29/11/2029                   | 272 640           | 0,01              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>          |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>          |                  |                   |
| <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 1.625% Agence Francaise de Developpement EPIC 25/05/2032           | 95 302           | 0,00              |
| 100 000 0.375% Agence Francaise de Developpement EPIC 25/05/2036           | 73 534           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Agence France Locale 20/06/2026                             | 98 749           | 0,00              |
| 100 000 3.000% Agence France Locale 20/03/2030                             | 107 497          | 0,01              |
| 200 000 0.625% Auckland Council 13/11/2024                                 | 207 738          | 0,01              |
| 100 000 3.375% Autobahnen- und Schnellstrassen-Finanzierungs AG 22/09/2025 | 109 063          | 0,01              |
| 200 000 0.000% Autobahnen- und Schnellstrassen-Finanzierungs AG 16/07/2027 | 191 346          | 0,01              |
| 100 000 0.500% Autonomous Community of Andalusia Spain 30/04/2031          | 86 171           | 0,00              |
| 100 000 1.826% Autonomous Community of Madrid Spain 30/04/2025             | 105 731          | 0,01              |
| 150 000 2.146% Autonomous Community of Madrid Spain 30/04/2027             | 156 564          | 0,01              |
| 100 000 1.773% Autonomous Community of Madrid Spain 30/04/2028             | 101 315          | 0,00              |
| 100 000 1.571% Autonomous Community of Madrid Spain 30/04/2029             | 98 656           | 0,00              |
| 200 000 2.822% Autonomous Community of Madrid Spain 31/10/2029             | 211 086          | 0,01              |
| 100 000 0.419% Autonomous Community of Madrid Spain 30/04/2030             | 88 881           | 0,00              |
| 200 000 1.125% Basque Government 30/04/2029                                | 192 467          | 0,01              |
| 100 000 0.200% BNG Bank NV 09/11/2024                                      | 103 497          | 0,00              |
| 100 000 0.050% BNG Bank NV 02/04/2025                                      | 102 151          | 0,00              |
| 100 000 0.250% BNG Bank NV 07/05/2025                                      | 102 251          | 0,00              |
| 100 000 0.125% BNG Bank NV 11/04/2026                                      | 99 481           | 0,00              |
| 200 000 2.750% BNG Bank NV 04/10/2027                                      | 215 228          | 0,01              |
| 100 000 0.750% BNG Bank NV 24/01/2029                                      | 95 550           | 0,00              |
| 100 000 0.050% BNG Bank NV 20/11/2029                                      | 89 438           | 0,00              |
| 200 000 0.000% BNG Bank NV 20/01/2031                                      | 172 074          | 0,01              |
| 100 000 0.250% BNG Bank NV 12/01/2032                                      | 85 436           | 0,00              |
| 100 000 1.875% BNG Bank NV 13/07/2032                                      | 98 463           | 0,00              |
| 200 000 0.125% BNG Bank NV 19/04/2033                                      | 162 472          | 0,01              |
| 200 000 0.125% BNG Bank NV 09/07/2035                                      | 151 238          | 0,01              |
| 150 000 0.875% BNG Bank NV 17/10/2035                                      | 124 991          | 0,01              |
| 300 000 0.875% BNG Bank NV 24/10/2036                                      | 244 138          | 0,01              |
| 100 000 0.250% BNG Bank NV 22/11/2036                                      | 73 177           | 0,00              |
| 100 000 1.250% BNG Bank NV 30/03/2037                                      | 84 457           | 0,00              |
| 100 000 2.500% Bpifrance SACA 25/05/2024                                   | 107 599          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Bpifrance SACA 25/11/2024                                   | 104 406          | 0,00              |
| 100 000 0.125% Bpifrance SACA 25/03/2025                                   | 102 375          | 0,00              |

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>    |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>    |                  |                   |
| <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 0.625% Bpifrance SACA 25/05/2026                             | 100 820          | 0,00              |
| 100 000 3.000% Bpifrance SACA 10/09/2026                             | 108 406          | 0,01              |
| 100 000 2.125% Bpifrance SACA 29/11/2027                             | 104 218          | 0,00              |
| 100 000 0.000% Bpifrance SACA 25/05/2028                             | 93 214           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Bpifrance SACA 25/11/2028                             | 92 354           | 0,00              |
| 100 000 0.250% Bpifrance SACA 29/03/2030                             | 89 504           | 0,00              |
| 100 000 1.875% Bpifrance SACA 25/05/2030                             | 100 553          | 0,00              |
| 200 000 3.375% Bpifrance SACA 25/11/2032                             | 220 721          | 0,01              |
| 100 000 4.125% Bulgaria Government International Bond 23/09/2029     | 106 745          | 0,01              |
| 150 000 0.375% Bulgaria Government International Bond 23/09/2030     | 122 745          | 0,01              |
| 100 000 4.625% Bulgaria Government International Bond 23/09/2034     | 106 798          | 0,01              |
| 100 000 3.125% Bulgaria Government International Bond 26/03/2035     | 92 699           | 0,00              |
| 725 000 0.000% Bundesobligation 05/04/2024                           | 765 755          | 0,03              |
| 850 000 0.000% Bundesobligation 18/10/2024                           | 886 035          | 0,03              |
| 1 100 000 0.000% Bundesobligation 11/04/2025                         | 1 133 320        | 0,04              |
| 1 300 000 0.000% Bundesobligation 10/10/2025                         | 1 326 466        | 0,05              |
| 1 350 000 0.000% Bundesobligation 10/04/2026                         | 1 362 556        | 0,05              |
| 1 300 000 0.000% Bundesobligation 09/10/2026                         | 1 298 773        | 0,05              |
| 1 050 000 0.000% Bundesobligation 16/04/2027                         | 1 038 103        | 0,04              |
| 1 650 000 1.300% Bundesobligation 15/10/2027                         | 1 713 542        | 0,07              |
| 1 000 000 2.200% Bundesobligation 13/04/2028                         | 1 079 638        | 0,04              |
| 1 000 000 1.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/05/2024 | 1 071 261        | 0,04              |
| 850 000 1.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2024   | 901 947          | 0,03              |
| 1 600 000 0.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2025 | 1 670 543        | 0,06              |
| 1 450 000 1.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2025 | 1 518 199        | 0,06              |
| 1 633 000 0.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2026 | 1 677 108        | 0,06              |
| 1 696 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2026 | 1 700 369        | 0,06              |
| 1 500 000 0.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2027 | 1 504 206        | 0,06              |
| 450 000 6.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2027   | 569 610          | 0,02              |
| 1 550 000 0.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2027 | 1 557 916        | 0,06              |
| 800 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/11/2027   | 781 609          | 0,03              |
| 300 000 5.625% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/01/2028   | 373 678          | 0,02              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>    |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>    |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>    |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>    |                  |                   |
| <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>  |                  |                   | <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 1 270 000 0.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2028 | 1 266 014        | 0,05              | 1 405 000 2.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2046 | 1 566 226        | 0,06              |
| 400 000 4.750% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2028   | 486 278          | 0,02              | 1 665 000 1.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2048 | 1 445 378        | 0,06              |
| 1 175 000 0.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2029 | 1 146 393        | 0,04              | 1 975 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2050 | 1 160 137        | 0,04              |
| 1 350 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/11/2028 | 1 292 287        | 0,05              | 825 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2052   | 461 453          | 0,02              |
| 1 350 000 0.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2029 | 1 305 516        | 0,05              | 500 000 1.800% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2053   | 477 104          | 0,02              |
| 1 150 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2029 | 1 083 257        | 0,04              | 550 000 0.200% Bundesschatzanweisungen 14/06/2024                    | 579 382          | 0,02              |
| 300 000 2.100% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/11/2029   | 322 007          | 0,01              | 900 000 0.400% Bundesschatzanweisungen 13/09/2024                    | 945 557          | 0,04              |
| 500 000 6.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/01/2030   | 677 836          | 0,03              | 800 000 2.200% Bundesschatzanweisungen 12/12/2024                    | 861 390          | 0,03              |
| 1 150 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2030 | 1 072 675        | 0,04              | 100 000 1.375% Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 25/11/2024 | 105 536          | 0,01              |
| 2 150 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2030 | 1 985 856        | 0,07              | 200 000 0.000% Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 25/02/2026 | 199 390          | 0,01              |
| 540 000 5.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/01/2031   | 720 194          | 0,03              | 300 000 0.000% Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 25/11/2026 | 293 025          | 0,01              |
| 1 400 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2031 | 1 277 954        | 0,05              | 400 000 2.875% Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 25/05/2027 | 431 999          | 0,02              |
| 1 700 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2031 | 1 535 532        | 0,06              | 200 000 1.750% Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 25/11/2027 | 205 850          | 0,01              |
| 1 250 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2032 | 1 115 485        | 0,04              | 200 000 0.000% Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 25/02/2028 | 188 047          | 0,01              |
| 1 500 000 1.700% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2032 | 1 552 999        | 0,06              | 400 000 0.000% Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 25/05/2029 | 363 000          | 0,01              |
| 600 000 2.300% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2033   | 651 622          | 0,03              | 200 000 0.600% Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 25/11/2029 | 186 383          | 0,01              |
| 800 000 4.750% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2034   | 1 074 664        | 0,04              | 200 000 0.000% Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 25/11/2030 | 173 237          | 0,01              |
| 1 150 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/05/2035 | 940 499          | 0,04              | 200 000 0.000% Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 25/05/2031 | 170 899          | 0,01              |
| 1 400 000 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/05/2036 | 1 113 500        | 0,04              | 200 000 0.125% Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 15/09/2031 | 171 357          | 0,01              |
| 915 000 4.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/01/2037   | 1 178 289        | 0,05              | 500 000 0.450% Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 19/01/2032 | 435 270          | 0,02              |
| 750 000 1.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/05/2038   | 667 254          | 0,03              | 200 000 1.500% Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 25/05/2032 | 190 831          | 0,01              |
| 525 000 4.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2039   | 708 186          | 0,03              | 100 000 0.000% Caisse des Depots et Consignations 19/06/2024         | 104 308          | 0,00              |
| 1 145 000 4.750% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2040 | 1 646 539        | 0,06              | 100 000 3.125% Caisse des Depots et Consignations 25/05/2033         | 109 597          | 0,01              |
| 775 000 3.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2042   | 946 566          | 0,04              | 100 000 0.375% Caisse Francaise de Financement Local 11/05/2024      | 105 046          | 0,01              |
| 1 190 000 2.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2044 | 1 316 328        | 0,05              | 50 000 5.375% Caisse Francaise de Financement Local 08/07/2024       | 55 553           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 100 000 0.010% Caisse Francaise de Financement Local 07/05/2025   | 101 359          | 0,00              |
| 100 000 1.125% Caisse Francaise de Financement Local 09/09/2025   | 103 064          | 0,00              |
| 200 000 0.625% Caisse Francaise de Financement Local 13/04/2026   | 200 552          | 0,01              |
| 100 000 0.500% Caisse Francaise de Financement Local 19/02/2027   | 97 836           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Caisse Francaise de Financement Local 25/04/2028   | 97 412           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Caisse Francaise de Financement Local 12/06/2028   | 97 795           | 0,00              |
| 200 000 3.250% Caisse Francaise de Financement Local 19/02/2029   | 217 494          | 0,01              |
| 100 000 0.010% Caisse Francaise de Financement Local 24/06/2030   | 86 439           | 0,00              |
| 200 000 0.010% Caisse Francaise de Financement Local 18/03/2031   | 168 645          | 0,01              |
| 100 000 1.250% Caisse Francaise de Financement Local 11/05/2032   | 91 624           | 0,00              |
| 100 000 1.450% Caisse Francaise de Financement Local 16/01/2034   | 90 306           | 0,00              |
| 100 000 0.375% Caisse Francaise de Financement Local 13/02/2040   | 67 026           | 0,00              |
| 100 000 2.125% Cassa Depositi e Prestiti SpA 21/03/2026           | 103 779          | 0,00              |
| 300 000 3.500% Cassa Depositi e Prestiti SpA 19/09/2027           | 320 006          | 0,01              |
| 100 000 1.125% CDP Financial Inc 06/04/2027                       | 99 742           | 0,00              |
| 100 000 1.750% Chile Government International Bond 20/01/2026     | 102 502          | 0,00              |
| 100 000 0.555% Chile Government International Bond 21/01/2029     | 89 726           | 0,00              |
| 100 000 1.440% Chile Government International Bond 01/02/2029     | 94 598           | 0,00              |
| 100 000 1.250% Chile Government International Bond 29/01/2040     | 72 408           | 0,00              |
| 100 000 1.250% Chile Government International Bond 22/01/2051     | 58 434           | 0,00              |
| 100 000 0.125% China Government International Bond 17/11/2028     | 89 822           | 0,00              |
| 100 000 0.625% China Government International Bond 17/11/2033     | 80 378           | 0,00              |
| 100 000 1.000% China Government International Bond 12/11/2039     | 74 890           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Croatia Government International Bond 19/06/2029   | 93 701           | 0,00              |
| 100 000 2.750% Croatia Government International Bond 27/01/2030   | 102 189          | 0,00              |
| 100 000 2.875% Croatia Government International Bond 22/04/2032   | 101 188          | 0,00              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 100 000 1.125% Croatia Government International Bond 04/03/2033   | 84 840           | 0,00              |
| 100 000 1.750% Croatia Government International Bond 04/03/2041   | 75 699           | 0,00              |
| 100 000 2.750% Cyprus Government International Bond 27/06/2024    | 108 529          | 0,01              |
| 126 000 2.750% Cyprus Government International Bond 26/02/2034    | 119 424          | 0,01              |
| 100 000 2.750% Cyprus Government International Bond 03/05/2049    | 86 305           | 0,00              |
| 100 000 0.010% Development Bank of Japan Inc 09/09/2025           | 99 954           | 0,00              |
| 100 000 0.875% Development Bank of Japan Inc 10/10/2025           | 101 834          | 0,00              |
| 100 000 1.500% Diageo Capital BV 08/06/2029                       | 97 198           | 0,00              |
| 200 000 0.500% European Stability Mechanism 05/03/2029            | 188 753          | 0,01              |
| 100 000 0.000% Export Development Canada 27/01/2025               | 102 424          | 0,00              |
| 300 000 0.500% Export Development Canada 25/02/2027               | 295 688          | 0,01              |
| 100 000 0.000% Export-Import Bank of China 15/10/2024             | 102 223          | 0,00              |
| 500 000 0.000% Finland Government Bond 15/09/2024                 | 521 262          | 0,02              |
| 100 000 4.000% Finland Government Bond 04/07/2025                 | 111 573          | 0,01              |
| 375 000 0.875% Finland Government Bond 15/09/2025                 | 389 806          | 0,02              |
| 100 000 0.500% Finland Government Bond 15/04/2026                 | 102 248          | 0,00              |
| 300 000 0.000% Finland Government Bond 15/09/2026                 | 297 794          | 0,01              |
| 100 000 1.375% Finland Government Bond 15/04/2027                 | 103 375          | 0,00              |
| 450 000 0.500% Finland Government Bond 15/09/2027                 | 445 952          | 0,02              |
| 50 000 2.750% Finland Government Bond 04/07/2028                  | 54 520           | 0,00              |
| 340 000 0.500% Finland Government Bond 15/09/2028                 | 328 616          | 0,01              |
| 370 000 0.500% Finland Government Bond 15/09/2029                 | 349 025          | 0,01              |
| 150 000 0.000% Finland Government Bond 15/09/2030                 | 132 791          | 0,01              |
| 200 000 0.750% Finland Government Bond 15/04/2031                 | 185 264          | 0,01              |
| 500 000 0.125% Finland Government Bond 15/09/2031                 | 434 173          | 0,02              |
| 250 000 1.500% Finland Government Bond 15/09/2032                 | 241 290          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                   |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>                   |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 170 000 1.125% Finland Government Bond 15/04/2034                                   | 153 121          | 0,01              | 1 350 000 3.500% French Republic Government Bond OAT 25/04/2026   | 1 501 644        | 0,06              |
| 150 000 0.125% Finland Government Bond 15/04/2036                                   | 111 882          | 0,01              | 2 475 000 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2026   | 2 515 068        | 0,10              |
| 250 000 0.250% Finland Government Bond 15/09/2040                                   | 169 432          | 0,01              | 1 650 000 0.250% French Republic Government Bond OAT 25/11/2026   | 1 645 269        | 0,06              |
| 145 000 2.625% Finland Government Bond 04/07/2042                                   | 148 809          | 0,01              | 2 300 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/02/2027   | 2 257 347        | 0,09              |
| 200 000 0.500% Finland Government Bond 15/04/2043                                   | 135 802          | 0,01              | 1 675 000 1.000% French Republic Government Bond OAT 25/05/2027   | 1 702 754        | 0,07              |
| 200 000 1.375% Finland Government Bond 15/04/2047                                   | 161 581          | 0,01              | 1 800 000 2.750% French Republic Government Bond OAT 25/10/2027   | 1 964 840        | 0,07              |
| 150 000 0.125% Finland Government Bond 15/04/2052                                   | 77 185           | 0,00              | 1 950 000 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/02/2028   | 1 934 388        | 0,07              |
| 100 000 2.125% Finnvera Oyj 08/03/2028  | 104 275          | 0,00              | 2 505 000 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/05/2028   | 2 476 372        | 0,09              |
| 100 000 0.375% Finnvera Oyj 09/04/2029  | 93 029           | 0,00              | 3 100 000 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/11/2028   | 3 037 729        | 0,12              |
| 100 000 0.050% Fondo De Titulacion Del Deficit Del Sistema Electrico FTA 17/09/2024 | 103 925          | 0,00              | 550 000 5.500% French Republic Government Bond OAT 25/04/2029     | 690 777          | 0,03              |
| 100 000 0.010% Fondo De Titulacion Del Deficit Del Sistema Electrico FTA 17/09/2025 | 100 977          | 0,00              | 2 950 000 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2029   | 2 818 853        | 0,11              |
| 250 000 0.500% Free and Hanseatic City of Hamburg 27/04/2026                        | 251 323          | 0,01              | 2 250 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2029   | 2 054 270        | 0,08              |
| 100 000 1.200% Free and Hanseatic City of Hamburg 03/06/2033                        | 91 741           | 0,00              | 2 420 000 2.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2030   | 2 604 415        | 0,10              |
| 33 000 1.450% Free and Hanseatic City of Hamburg 05/11/2038                         | 28 209           | 0,00              | 2 700 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2030   | 2 395 456        | 0,09              |
| 50 000 0.400% Free and Hanseatic City of Hamburg 23/11/2051                         | 26 550           | 0,00              | 2 422 000 1.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2031   | 2 409 530        | 0,09              |
| 100 000 0.010% Free State of Bavaria 18/01/2035                                     | 76 432           | 0,00              | 2 450 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2031   | 2 108 600        | 0,08              |
| 200 000 0.010% Free State of Saxony 17/12/2035                                      | 147 281          | 0,01              | 2 050 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/05/2032   | 1 734 583        | 0,07              |
| 1 925 000 2.250% French Republic Government Bond OAT 25/05/2024                     | 2 073 681        | 0,08              | 800 000 5.750% French Republic Government Bond OAT 25/10/2032     | 1 083 755        | 0,04              |
| 1 700 000 1.750% French Republic Government Bond OAT 25/11/2024                     | 1 814 551        | 0,07              | 2 900 000 2.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2032   | 2 938 356        | 0,11              |
| 3 500 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/02/2025                     | 3 607 427        | 0,14              | 2 007 000 1.250% French Republic Government Bond OAT 25/05/2034   | 1 830 512        | 0,07              |
| 2 050 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/03/2025                     | 2 109 024        | 0,08              | 675 000 4.750% French Republic Government Bond OAT 25/04/2035     | 862 285          | 0,03              |
| 2 450 000 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2025                     | 2 537 656        | 0,10              | 1 250 000 1.250% French Republic Government Bond OAT 25/05/2036   | 1 095 277        | 0,04              |
| 243 000 6.000% French Republic Government Bond OAT 25/10/2025                       | 285 014          | 0,01              | 650 000 1.250% French Republic Government Bond OAT 25/05/2038     | 548 521          | 0,02              |
| 1 750 000 1.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2025                     | 1 820 121        | 0,07              | 875 000 4.000% French Republic Government Bond OAT 25/10/2038     | 1 052 201        | 0,04              |
| 2 400 000 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/02/2026                     | 2 415 178        | 0,09              | 1 620 000 1.750% French Republic Government Bond OAT 25/06/2039   | 1 466 385        | 0,06              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 1 400 000 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2040   | 991 757          | 0,04              |
| 1 110 000 4.500% French Republic Government Bond OAT 25/04/2041   | 1 423 394        | 0,05              |
| 1 000 000 2.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2043   | 971 688          | 0,04              |
| 900 000 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/06/2044     | 583 779          | 0,02              |
| 1 015 000 3.250% French Republic Government Bond OAT 25/05/2045   | 1 112 418        | 0,04              |
| 1 700 000 2.000% French Republic Government Bond OAT 25/05/2048   | 1 469 704        | 0,06              |
| 1 610 000 1.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2050   | 1 220 721        | 0,05              |
| 1 650 000 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/05/2052   | 981 131          | 0,04              |
| 1 400 000 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/05/2053   | 809 431          | 0,03              |
| 200 000 3.000% French Republic Government Bond OAT 25/05/2054     | 206 291          | 0,01              |
| 490 000 4.000% French Republic Government Bond OAT 25/04/2055     | 611 299          | 0,02              |
| 690 000 4.000% French Republic Government Bond OAT 25/04/2060     | 871 446          | 0,03              |
| 775 000 1.750% French Republic Government Bond OAT 25/05/2066     | 578 057          | 0,02              |
| 450 000 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2072     | 193 669          | 0,01              |
| 100 000 1.125% Gemeinsame Deutsche Bundeslaender 30/09/2024       | 105 293          | 0,01              |
| 100 000 0.000% Gemeinsame Deutsche Bundeslaender 19/02/2027       | 96 777           | 0,00              |
| 100 000 0.010% Gemeinsame Deutsche Bundeslaender 08/10/2027       | 95 203           | 0,00              |
| 100 000 0.010% Gemeinsame Deutsche Bundeslaender 26/08/2030       | 87 666           | 0,00              |
| 100 000 2.875% Gestion Securite de Stocks Securite SA 07/09/2032  | 104 225          | 0,00              |
| 300 000 3.875% Hong Kong Government International Bond 11/01/2025 | 328 018          | 0,01              |
| 50 000 5.000% Hungary Government International Bond 22/02/2027    | 54 702           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Hungary Government International Bond 21/09/2028   | 83 405           | 0,00              |
| 100 000 1.625% Hungary Government International Bond 28/04/2032   | 80 057           | 0,00              |
| 50 000 1.750% Hungary Government International Bond 05/06/2035    | 37 042           | 0,00              |
| 100 000 1.500% Hungary Government International Bond 17/11/2050   | 55 436           | 0,00              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 100 000 3.050% Ile-de-France Mobilites 03/02/2033                 | 107 251          | 0,01              |
| 200 000 0.200% Ile-de-France Mobilites 16/11/2035                 | 146 914          | 0,01              |
| 100 000 0.900% Indonesia Government International Bond 14/02/2027 | 96 752           | 0,00              |
| 100 000 1.400% Indonesia Government International Bond 30/10/2031 | 85 241           | 0,00              |
| 200 000 1.100% Indonesia Government International Bond 12/03/2033 | 159 943          | 0,01              |
| 100 000 0.000% Instituto de Credito Oficial 30/04/2026            | 99 005           | 0,00              |
| 100 000 0.010% Investitionsbank Schleswig-Holstein 27/10/2028     | 92 327           | 0,00              |
| 438 000 5.400% Ireland Government Bond 13/03/2025                 | 500 815          | 0,02              |
| 700 000 1.000% Ireland Government Bond 15/05/2026                 | 724 276          | 0,03              |
| 544 000 0.200% Ireland Government Bond 15/05/2027                 | 535 697          | 0,02              |
| 275 000 0.900% Ireland Government Bond 15/05/2028                 | 274 188          | 0,01              |
| 600 000 1.100% Ireland Government Bond 15/05/2029                 | 596 761          | 0,02              |
| 300 000 2.400% Ireland Government Bond 15/05/2030                 | 322 099          | 0,01              |
| 550 000 0.200% Ireland Government Bond 18/10/2030                 | 498 767          | 0,02              |
| 225 000 1.350% Ireland Government Bond 18/03/2031                 | 221 901          | 0,01              |
| 350 000 0.000% Ireland Government Bond 18/10/2031                 | 301 955          | 0,01              |
| 200 000 0.350% Ireland Government Bond 18/10/2032                 | 174 030          | 0,01              |
| 200 000 1.300% Ireland Government Bond 15/05/2033                 | 189 201          | 0,01              |
| 150 000 0.400% Ireland Government Bond 15/05/2035                 | 120 734          | 0,01              |
| 275 000 1.700% Ireland Government Bond 15/05/2037                 | 253 094          | 0,01              |
| 300 000 0.550% Ireland Government Bond 22/04/2041                 | 210 847          | 0,01              |
| 350 000 2.000% Ireland Government Bond 18/02/2045                 | 310 735          | 0,01              |
| 325 000 1.500% Ireland Government Bond 15/05/2050                 | 247 316          | 0,01              |
| 200 000 1.500% Israel Government International Bond 16/01/2029    | 190 628          | 0,01              |
| 100 000 0.625% Israel Government International Bond 18/01/2032    | 81 349           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                     |                  |                   | <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 100 000 2.375% Israel Government International Bond 18/01/2037    | 86 603           | 0,00              | 1 250 000 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2026     | 1 214 814        | 0,05              |
| 50 000 2.500% Israel Government International Bond 16/01/2049     | 41 439           | 0,00              | 250 000 7.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/11/2026       | 306 727          | 0,01              |
| 1 250 000 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/04/2024     | 1 314 577        | 0,05              | 1 250 000 1.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2026     | 1 259 372        | 0,05              |
| 706 000 1.850% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/05/2024       | 755 942          | 0,03              | 793 000 0.850% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/01/2027       | 784 325          | 0,03              |
| 800 000 1.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 30/05/2024       | 854 341          | 0,03              | 900 000 1.100% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/04/2027       | 894 056          | 0,03              |
| 550 000 1.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/07/2024       | 587 078          | 0,02              | 679 000 2.200% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/06/2027       | 702 792          | 0,03              |
| 750 000 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/08/2024       | 780 810          | 0,03              | 912 000 2.050% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2027       | 935 553          | 0,04              |
| 800 000 3.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2024       | 875 374          | 0,03              | 980 000 0.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/09/2027       | 955 459          | 0,04              |
| 1 050 000 1.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/11/2024     | 1 110 485        | 0,04              | 750 000 6.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/11/2027       | 919 601          | 0,04              |
| 825 000 2.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2024       | 886 811          | 0,03              | 1 000 000 2.650% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2027     | 1 046 936        | 0,04              |
| 1 150 000 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/12/2024     | 1 184 223        | 0,05              | 900 000 2.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/02/2028       | 912 908          | 0,04              |
| 1 184 000 0.350% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/02/2025     | 1 221 601        | 0,05              | 975 000 0.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/03/2028       | 902 164          | 0,03              |
| 605 000 5.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2025       | 678 441          | 0,03              | 250 000 3.400% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/04/2028       | 269 247          | 0,01              |
| 1 100 000 1.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/05/2025     | 1 152 131        | 0,04              | 1 200 000 0.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/07/2028     | 1 111 908        | 0,04              |
| 775 000 1.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/06/2025       | 811 148          | 0,03              | 563 000 4.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2028       | 647 056          | 0,03              |
| 1 050 000 1.850% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/07/2025     | 1 106 469        | 0,04              | 1 304 000 2.800% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2028     | 1 359 566        | 0,05              |
| 700 000 1.200% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/08/2025       | 724 444          | 0,03              | 750 000 0.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/02/2029       | 678 393          | 0,03              |
| 789 000 2.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/11/2025       | 840 168          | 0,03              | 800 000 2.800% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/06/2029       | 825 971          | 0,03              |
| 700 000 2.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2025       | 734 946          | 0,03              | 1 300 000 3.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2029     | 1 359 265        | 0,05              |
| 500 000 3.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/01/2026       | 544 904          | 0,02              | 650 000 5.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/11/2029       | 771 501          | 0,03              |
| 1 000 000 0.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/02/2026     | 1 003 391        | 0,04              | 750 000 3.850% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/12/2029       | 817 673          | 0,03              |
| 750 000 4.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2026       | 840 521          | 0,03              | 800 000 3.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2030       | 856 966          | 0,03              |
| 1 050 000 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/04/2026     | 1 032 467        | 0,04              | 1 243 000 1.350% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/04/2030     | 1 150 509        | 0,04              |
| 1 150 000 1.600% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/06/2026     | 1 184 085        | 0,05              | 1 100 000 0.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2030     | 978 233          | 0,04              |
| 700 000 2.100% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/07/2026       | 730 992          | 0,03              | 950 000 1.650% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2030       | 883 759          | 0,03              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                     |                  |                   | <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 1 250 000 0.900% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/04/2031     | 1 085 010        | 0,04              | 700 000 1.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 30/04/2045       | 460 712          | 0,02              |
| 450 000 6.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/05/2031       | 562 321          | 0,02              | 857 000 3.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2046       | 785 968          | 0,03              |
| 946 000 0.600% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2031       | 790 087          | 0,03              | 961 000 2.700% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2047       | 798 093          | 0,03              |
| 900 000 0.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2031       | 767 215          | 0,03              | 725 000 3.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2048       | 682 356          | 0,03              |
| 1 118 000 1.650% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2032     | 1 010 492        | 0,04              | 600 000 3.850% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2049       | 599 029          | 0,02              |
| 1 000 000 0.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/06/2032     | 838 718          | 0,03              | 750 000 2.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2050       | 572 480          | 0,02              |
| 1 000 000 2.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2032     | 957 597          | 0,04              | 600 000 1.700% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2051       | 383 736          | 0,02              |
| 750 000 5.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/02/2033       | 924 979          | 0,04              | 550 000 2.150% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2052       | 385 293          | 0,02              |
| 2 050 000 4.400% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/05/2033     | 2 285 635        | 0,09              | 200 000 4.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/10/2053       | 218 418          | 0,01              |
| 1 193 000 2.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2033     | 1 117 916        | 0,04              | 300 000 2.800% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2067       | 228 480          | 0,01              |
| 692 000 5.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2034       | 806 759          | 0,03              | 200 000 2.150% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2072       | 126 884          | 0,01              |
| 850 000 3.350% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2035       | 847 323          | 0,03              | 650 000 2.600% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2024      | 703 855          | 0,03              |
| 400 000 4.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 30/04/2035       | 425 002          | 0,02              | 500 000 0.500% Kingdom of Belgium Government Bond 22/10/2024      | 524 696          | 0,02              |
| 650 000 1.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2036       | 516 827          | 0,02              | 1 300 000 0.800% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2025    | 1 355 296        | 0,05              |
| 940 000 2.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2036       | 820 483          | 0,03              | 300 000 4.500% Kingdom of Belgium Government Bond 28/03/2026      | 342 874          | 0,01              |
| 696 000 4.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/02/2037       | 739 201          | 0,03              | 1 050 000 1.000% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2026    | 1 082 981        | 0,04              |
| 1 200 000 0.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2037     | 864 119          | 0,03              | 850 000 0.800% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2027      | 855 865          | 0,03              |
| 450 000 3.250% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2038       | 431 412          | 0,02              | 700 000 0.000% Kingdom of Belgium Government Bond 22/10/2027      | 675 162          | 0,03              |
| 847 000 2.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2038       | 783 717          | 0,03              | 300 000 5.500% Kingdom of Belgium Government Bond 28/03/2028      | 369 177          | 0,01              |
| 850 000 5.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2039       | 993 270          | 0,04              | 850 000 0.800% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2028      | 842 318          | 0,03              |
| 1 000 000 3.100% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2040     | 927 350          | 0,04              | 875 000 0.900% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2029      | 855 779          | 0,03              |
| 400 000 5.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2040       | 468 907          | 0,02              | 725 000 0.100% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2030      | 652 747          | 0,03              |
| 1 048 000 1.800% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2041     | 785 474          | 0,03              | 600 000 1.000% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2031      | 565 758          | 0,02              |
| 250 000 4.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2043       | 272 191          | 0,01              | 850 000 0.000% Kingdom of Belgium Government Bond 22/10/2031      | 725 460          | 0,03              |
| 550 000 4.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/09/2044       | 627 461          | 0,02              | 250 000 4.000% Kingdom of Belgium Government Bond 28/03/2032      | 295 381          | 0,01              |



## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 1 000 000 0.350% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2032    | 864 662          | 0,03              |
| 370 000 1.250% Kingdom of Belgium Government Bond 22/04/2033      | 345 278          | 0,01              |
| 425 000 3.000% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2034      | 459 169          | 0,02              |
| 375 000 5.000% Kingdom of Belgium Government Bond 28/03/2035      | 484 254          | 0,02              |
| 625 000 1.450% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2037      | 546 573          | 0,02              |
| 550 000 1.900% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2038      | 504 384          | 0,02              |
| 250 000 2.750% Kingdom of Belgium Government Bond 22/04/2039      | 255 204          | 0,01              |
| 500 000 0.400% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2040      | 340 722          | 0,01              |
| 650 000 4.250% Kingdom of Belgium Government Bond 28/03/2041      | 798 280          | 0,03              |
| 320 000 3.750% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2045      | 371 396          | 0,02              |
| 515 000 1.600% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2047      | 401 854          | 0,02              |
| 400 000 1.700% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2050      | 310 755          | 0,01              |
| 600 000 1.400% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2053      | 415 697          | 0,02              |
| 200 000 3.300% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2054      | 213 500          | 0,01              |
| 300 000 2.250% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2057      | 256 468          | 0,01              |
| 290 000 2.150% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2066      | 238 486          | 0,01              |
| 300 000 0.650% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2071      | 136 929          | 0,01              |
| 200 000 0.625% Kommunalbanken AS 20/04/2026                       | 200 843          | 0,01              |
| 100 000 2.750% Kommunalbanken AS 29/11/2027                       | 106 651          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Kommunekredit 05/07/2028                           | 96 866           | 0,00              |
| 100 000 0.000% Kommunekredit 03/03/2031                           | 85 697           | 0,00              |
| 100 000 2.375% Kommunekredit 15/09/2032                           | 102 611          | 0,00              |
| 100 000 0.625% Kommunekredit 21/11/2039                           | 73 319           | 0,00              |
| 100 000 0.723% Korea Housing Finance Corp 22/03/2025              | 102 391          | 0,00              |
| 100 000 0.010% Korea Housing Finance Corp 29/06/2026              | 96 588           | 0,00              |
| 100 000 0.000% Kuntarahoitus Oyj 15/11/2024                       | 103 136          | 0,00              |
| 200 000 0.000% Kuntarahoitus Oyj 22/04/2025                       | 203 438          | 0,01              |
| 300 000 0.000% Kuntarahoitus Oyj 14/10/2030                       | 261 410          | 0,01              |
| 100 000 0.000% Kuntarahoitus Oyj 02/03/2031                       | 86 035           | 0,00              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 100 000 0.050% Kuntarahoitus Oyj 10/09/2035                       | 74 777           | 0,00              |
| 50 000 0.625% Land Baden-Wuerttemberg 16/01/2025                  | 51 906           | 0,00              |
| 100 000 0.010% Land Baden-Wuerttemberg 04/08/2027                 | 95 626           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Land Baden-Wuerttemberg 19/11/2040                 | 64 046           | 0,00              |
| 100 000 0.250% Land Berlin 22/04/2025                             | 102 354          | 0,00              |
| 100 000 0.625% Land Berlin 08/02/2027                             | 99 290           | 0,00              |
| 100 000 0.010% Land Berlin 18/05/2027                             | 96 251           | 0,00              |
| 100 000 1.250% Land Berlin 01/06/2028                             | 99 855           | 0,00              |
| 100 000 0.625% Land Berlin 05/02/2029                             | 95 266           | 0,00              |
| 100 000 0.010% Land Berlin 02/07/2030                             | 87 876           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Land Berlin 20/10/2031                             | 85 595           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Land Berlin 19/05/2032                             | 91 735           | 0,00              |
| 50 000 1.300% Land Berlin 13/06/2033                              | 46 293           | 0,00              |
| 100 000 0.750% Land Berlin 03/04/2034                             | 85 256           | 0,00              |
| 200 000 0.125% Land Berlin 04/06/2035                             | 152 153          | 0,01              |
| 100 000 0.100% Land Berlin 18/01/2041                             | 63 213           | 0,00              |
| 100 000 0.350% Land Berlin 09/09/2050                             | 53 347           | 0,00              |
| 100 000 0.875% Land Thueringen 25/11/2024                         | 104 591          | 0,00              |
| 50 000 0.050% Land Thueringen 06/05/2030                          | 44 364           | 0,00              |
| 100 000 0.125% Land Thueringen 13/01/2051                         | 48 562           | 0,00              |
| 100 000 1.125% Latvia Government International Bond 30/05/2028    | 96 011           | 0,00              |
| 100 000 1.875% Latvia Government International Bond 19/02/2049    | 76 572           | 0,00              |
| 100 000 0.500% Lithuania Government International Bond 19/06/2029 | 89 694           | 0,00              |
| 100 000 1.625% Mexico Government International Bond 08/04/2026    | 102 046          | 0,00              |
| 100 000 1.125% Mexico Government International Bond 17/01/2030    | 88 455           | 0,00              |
| 100 000 1.450% Mexico Government International Bond 25/10/2033    | 78 418           | 0,00              |
| 100 000 2.250% Mexico Government International Bond 12/08/2036    | 77 478           | 0,00              |
| 200 000 2.875% Mexico Government International Bond 08/04/2039    | 159 254          | 0,01              |
| 200 000 2.125% Mexico Government International Bond 25/10/2051    | 121 752          | 0,01              |
| 100 000 1.375% MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt 24/06/2025         | 100 012          | 0,00              |
| 100 000 0.375% Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 15/04/2030  | 90 323           | 0,00              |
| 100 000 0.300% Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 20/10/2031  | 85 611           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                       | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                     |                  |                   | <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                      |                  |                   |
| 100 000 3.250% Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 12/01/2043  | 103 455          | 0,00              | 450 000 0.000% Netherlands Government Bond 15/07/2030              | 406 801          | 0,02              |
| 100 000 1.500% Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 11/04/2044  | 75 745           | 0,00              | 650 000 0.000% Netherlands Government Bond 15/07/2031              | 572 722          | 0,02              |
| 100 000 0.875% Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 21/03/2046  | 63 171           | 0,00              | 700 000 0.500% Netherlands Government Bond 15/07/2032              | 630 916          | 0,02              |
| 100 000 0.000% Nederlandse Waterschapsbank NV 16/11/2026          | 97 453           | 0,00              | 800 000 2.500% Netherlands Government Bond 15/01/2033              | 860 825          | 0,03              |
| 200 000 0.625% Nederlandse Waterschapsbank NV 18/01/2027          | 198 727          | 0,01              | 1 000 000 2.500% Netherlands Government Bond 15/07/2033            | 1 072 163        | 0,04              |
| 100 000 3.250% Nederlandse Waterschapsbank NV 09/03/2027          | 109 289          | 0,01              | 550 000 4.000% Netherlands Government Bond 15/01/2037              | 683 188          | 0,03              |
| 100 000 0.125% Nederlandse Waterschapsbank NV 28/05/2027          | 96 437           | 0,00              | 500 000 0.000% Netherlands Government Bond 15/01/2038              | 363 385          | 0,01              |
| 100 000 1.000% Nederlandse Waterschapsbank NV 01/03/2028          | 98 652           | 0,00              | 750 000 0.500% Netherlands Government Bond 15/01/2040              | 572 782          | 0,02              |
| 100 000 0.625% Nederlandse Waterschapsbank NV 06/02/2029          | 94 734           | 0,00              | 870 000 3.750% Netherlands Government Bond 15/01/2042              | 1 083 874        | 0,04              |
| 500 000 2.750% Nederlandse Waterschapsbank NV 17/12/2029          | 533 295          | 0,02              | 735 000 2.750% Netherlands Government Bond 15/01/2047              | 813 689          | 0,03              |
| 100 000 0.000% Nederlandse Waterschapsbank NV 08/09/2031          | 84 586           | 0,00              | 600 000 0.000% Netherlands Government Bond 15/01/2052              | 320 322          | 0,01              |
| 100 000 0.125% Nederlandse Waterschapsbank NV 03/09/2035          | 74 824           | 0,00              | 250 000 2.000% Netherlands Government Bond 15/01/2054              | 237 596          | 0,01              |
| 100 000 0.000% Nederlandse Waterschapsbank NV 16/02/2037          | 70 161           | 0,00              | 400 000 0.500% Ontario Teachers' Finance Trust 06/05/2025          | 408 431          | 0,02              |
| 100 000 0.750% Nederlandse Waterschapsbank NV 04/10/2041          | 70 684           | 0,00              | 100 000 3.300% Ontario Teachers' Finance Trust 05/10/2029          | 107 401          | 0,01              |
| 100 000 0.375% Nederlandse Waterschapsbank NV 28/09/2046          | 58 931           | 0,00              | 100 000 3.750% Peruvian Government International Bond 01/03/2030   | 103 460          | 0,00              |
| 1 000 000 2.000% Netherlands Government Bond 15/07/2024           | 1 076 107        | 0,04              | 100 000 1.950% Peruvian Government International Bond 17/11/2036   | 76 198           | 0,00              |
| 900 000 0.250% Netherlands Government Bond 15/07/2025             | 926 587          | 0,04              | 200 000 1.750% Philippine Government International Bond 28/04/2041 | 137 334          | 0,01              |
| 500 000 0.000% Netherlands Government Bond 15/01/2026             | 505 471          | 0,02              | 303 000 2.875% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 15/10/2025        | 330 643          | 0,01              |
| 1 350 000 0.500% Netherlands Government Bond 15/07/2026           | 1 372 222        | 0,05              | 900 000 2.875% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 21/07/2026        | 984 073          | 0,04              |
| 950 000 0.000% Netherlands Government Bond 15/01/2027             | 938 534          | 0,04              | 450 000 4.125% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 14/04/2027        | 515 215          | 0,02              |
| 800 000 0.750% Netherlands Government Bond 15/07/2027             | 806 554          | 0,03              | 550 000 0.700% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 15/10/2027        | 547 987          | 0,02              |
| 108 000 5.500% Netherlands Government Bond 15/01/2028             | 132 661          | 0,01              | 550 000 2.125% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 17/10/2028        | 579 101          | 0,02              |
| 450 000 0.750% Netherlands Government Bond 15/07/2028             | 446 436          | 0,02              | 600 000 1.950% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 15/06/2029        | 621 199          | 0,02              |
| 550 000 0.000% Netherlands Government Bond 15/01/2029             | 516 693          | 0,02              | 150 000 3.875% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 15/02/2030        | 172 975          | 0,01              |
| 565 000 0.250% Netherlands Government Bond 15/07/2029             | 533 228          | 0,02              | 400 000 0.475% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 18/10/2030        | 362 605          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                     |                  |                   | <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 450 000 0.300% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 17/10/2031       | 389 782          | 0,02              | 700 000 0.000% Republic of Austria Government Bond 15/07/2024     | 734 361          | 0,03              |
| 300 000 1.650% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 16/07/2032       | 287 677          | 0,01              | 300 000 1.650% Republic of Austria Government Bond 21/10/2024     | 320 176          | 0,01              |
| 375 000 2.250% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 18/04/2034       | 371 187          | 0,02              | 850 000 0.000% Republic of Austria Government Bond 20/04/2025     | 872 913          | 0,03              |
| 548 000 0.900% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 12/10/2035       | 450 133          | 0,02              | 600 000 1.200% Republic of Austria Government Bond 20/10/2025     | 627 959          | 0,02              |
| 125 000 4.100% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 15/04/2037       | 146 372          | 0,01              | 350 000 4.850% Republic of Austria Government Bond 15/03/2026     | 403 408          | 0,02              |
| 300 000 1.150% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 11/04/2042       | 218 741          | 0,01              | 300 000 2.000% Republic of Austria Government Bond 15/07/2026     | 318 618          | 0,01              |
| 75 000 4.100% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 15/02/2045        | 87 782           | 0,00              | 850 000 0.750% Republic of Austria Government Bond 20/10/2026     | 865 442          | 0,03              |
| 100 000 1.000% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 12/04/2052       | 57 868           | 0,00              | 450 000 0.500% Republic of Austria Government Bond 20/04/2027     | 448 231          | 0,02              |
| 200 000 0.500% Province of Alberta Canada 16/04/2025              | 205 417          | 0,01              | 600 000 0.750% Republic of Austria Government Bond 20/02/2028     | 594 388          | 0,02              |
| 100 000 0.625% Province of Ontario Canada 17/04/2025              | 102 811          | 0,00              | 250 000 0.000% Republic of Austria Government Bond 20/10/2028     | 233 869          | 0,01              |
| 200 000 0.375% Province of Ontario Canada 08/04/2027              | 194 186          | 0,01              | 600 000 0.500% Republic of Austria Government Bond 20/02/2029     | 572 296          | 0,02              |
| 100 000 0.010% Province of Ontario Canada 25/11/2030              | 85 013           | 0,00              | 550 000 0.000% Republic of Austria Government Bond 20/02/2030     | 492 750          | 0,02              |
| 200 000 0.200% Province of Quebec Canada 07/04/2025               | 203 974          | 0,01              | 500 000 0.000% Republic of Austria Government Bond 20/02/2031     | 434 808          | 0,02              |
| 100 000 1.125% Province of Quebec Canada 28/10/2025               | 102 838          | 0,00              | 650 000 0.900% Republic of Austria Government Bond 20/02/2032     | 596 676          | 0,02              |
| 100 000 0.875% Province of Quebec Canada 04/05/2027               | 98 915           | 0,00              | 1 200 000 2.900% Republic of Austria Government Bond 20/02/2033   | 1 299 279        | 0,05              |
| 200 000 0.000% Province of Quebec Canada 15/10/2029               | 176 366          | 0,01              | 375 000 2.400% Republic of Austria Government Bond 23/05/2034     | 385 418          | 0,02              |
| 100 000 0.000% Province of Quebec Canada 29/10/2030               | 85 281           | 0,00              | 450 000 0.250% Republic of Austria Government Bond 20/10/2036     | 338 052          | 0,01              |
| 200 000 0.250% Province of Quebec Canada 05/05/2031               | 171 311          | 0,01              | 375 000 4.150% Republic of Austria Government Bond 15/03/2037     | 456 150          | 0,02              |
| 200 000 0.500% Province of Quebec Canada 25/01/2032               | 170 899          | 0,01              | 500 000 0.000% Republic of Austria Government Bond 20/10/2040     | 318 438          | 0,01              |
| 100 000 0.500% Region of Ile de France 14/06/2025                 | 102 518          | 0,00              | 195 000 3.150% Republic of Austria Government Bond 20/06/2044     | 217 019          | 0,01              |
| 100 000 0.100% Region of Ile de France 02/07/2030                 | 87 571           | 0,00              | 350 000 1.500% Republic of Austria Government Bond 20/02/2047     | 283 037          | 0,01              |
| 200 000 0.050% Region Wallonne Belgium 22/06/2025                 | 203 320          | 0,01              | 250 000 1.850% Republic of Austria Government Bond 23/05/2049     | 213 944          | 0,01              |
| 100 000 3.250% Region Wallonne Belgium 22/06/2033                 | 107 403          | 0,01              | 185 000 2.100% Republic of Austria Government Bond 12/12/2049     | 149 804          | 0,01              |
| 100 000 2.875% Region Wallonne Belgium 14/01/2038                 | 99 664           | 0,00              | 450 000 0.750% Republic of Austria Government Bond 20/03/2051     | 283 774          | 0,01              |
| 100 000 0.650% Region Wallonne Belgium 16/01/2051                 | 51 804           | 0,00              | 95 000 3.800% Republic of Austria Government Bond 26/01/2062      | 121 174          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>          |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>          |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>  |                  |                   | <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 250 000 0.700% Republic of Austria Government Bond 20/04/2071              | 124 684          | 0,01              | 100 000 2.000% Slovakia Government Bond 17/10/2047                | 77 902           | 0,00              |
| 140 000 1.500% Republic of Austria Government Bond 02/11/2086              | 92 547           | 0,00              | 100 000 1.000% Slovakia Government Bond 13/10/2051                | 56 556           | 0,00              |
| 200 000 0.850% Republic of Austria Government Bond 30/06/2120              | 93 313           | 0,00              | 275 000 1.000% Slovenia Government Bond 06/03/2028                | 270 641          | 0,01              |
| 100 000 0.000% Republic of Poland Government International Bond 10/02/2025 | 101 412          | 0,00              | 250 000 0.275% Slovenia Government Bond 14/01/2030                | 223 230          | 0,01              |
| 500 000 2.750% Republic of Poland Government International Bond 25/05/2032 | 487 724          | 0,02              | 250 000 0.000% Slovenia Government Bond 12/02/2031                | 211 146          | 0,01              |
| 200 000 3.625% Romanian Government International Bond 24/04/2024           | 216 823          | 0,01              | 150 000 2.250% Slovenia Government Bond 03/03/2032                | 150 175          | 0,01              |
| 100 000 2.000% Romanian Government International Bond 08/12/2026           | 97 587           | 0,00              | 50 000 1.750% Slovenia Government Bond 03/11/2040                 | 41 347           | 0,00              |
| 50 000 2.125% Romanian Government International Bond 07/03/2028            | 46 258           | 0,00              | 100 000 3.125% Slovenia Government Bond 07/08/2045                | 100 930          | 0,00              |
| 50 000 2.875% Romanian Government International Bond 11/03/2029            | 46 312           | 0,00              | 100 000 4.250% SNCF Reseau 07/10/2026                             | 112 796          | 0,01              |
| 50 000 1.375% Romanian Government International Bond 02/12/2029            | 40 732           | 0,00              | 200 000 0.875% SNCF Reseau 22/01/2029                             | 191 871          | 0,01              |
| 100 000 2.000% Romanian Government International Bond 14/04/2033           | 74 131           | 0,00              | 100 000 1.000% SNCF Reseau 09/11/2031                             | 91 350           | 0,00              |
| 50 000 3.750% Romanian Government International Bond 07/02/2034            | 42 450           | 0,00              | 100 000 1.875% SNCF Reseau 30/03/2034                             | 94 069           | 0,00              |
| 300 000 4.125% Romanian Government International Bond 11/03/2039           | 240 960          | 0,01              | 100 000 2.000% SNCF Reseau 05/02/2048                             | 78 256           | 0,00              |
| 50 000 2.875% Romanian Government International Bond 13/04/2042            | 31 899           | 0,00              | 200 000 0.000% Societe Du Grand Paris EPIC 25/11/2030             | 171 789          | 0,01              |
| 200 000 4.625% Romanian Government International Bond 03/04/2049           | 161 375          | 0,01              | 100 000 0.300% Societe Du Grand Paris EPIC 25/11/2031             | 85 118           | 0,00              |
| 100 000 3.375% Romanian Government International Bond 28/01/2050           | 65 431           | 0,00              | 200 000 0.300% Societe Du Grand Paris EPIC 02/09/2036             | 143 416          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Saudi Government International Bond 09/07/2027              | 95 964           | 0,00              | 100 000 1.625% Societe Du Grand Paris EPIC 08/04/2042             | 78 529           | 0,00              |
| 100 000 0.750% SFIL SA 06/02/2026  | 101 748          | 0,00              | 100 000 0.875% Societe Du Grand Paris EPIC 10/05/2046             | 62 174           | 0,00              |
| 500 000 0.250% Slovakia Government Bond 14/05/2025                         | 510 919          | 0,02              | 200 000 0.700% Societe Du Grand Paris EPIC 15/10/2060             | 85 045           | 0,00              |
| 300 000 0.125% Slovakia Government Bond 17/06/2027                         | 286 657          | 0,01              | 100 000 1.000% Societe Du Grand Paris EPIC 18/02/2070             | 44 801           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Slovakia Government Bond 12/06/2028                         | 97 171           | 0,00              | 200 000 1.500% Societe Nationale SNCF SA 02/02/2029               | 197 821          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Slovakia Government Bond 09/04/2030                         | 91 229           | 0,00              | 100 000 1.000% Societe Nationale SNCF SA 25/05/2040               | 71 295           | 0,00              |
| 200 000 1.000% Slovakia Government Bond 09/10/2030                         | 182 884          | 0,01              | 100 000 0.875% Societe Nationale SNCF SA 28/02/2051               | 53 032           | 0,00              |
| 100 000 1.000% Slovakia Government Bond 14/05/2032                         | 87 295           | 0,00              | 200 000 1.000% Societe Nationale SNCF SA 19/01/2061               | 91 670           | 0,00              |
| 100 000 0.375% Slovakia Government Bond 21/04/2036                         | 69 857           | 0,00              | 650 000 3.800% Spain Government Bond 30/04/2024                   | 712 605          | 0,03              |
| 200 000 1.875% Slovakia Government Bond 09/03/2037                         | 172 209          | 0,01              | 1 231 000 0.000% Spain Government Bond 31/05/2024                 | 1 293 392        | 0,05              |
|  |                  |                   | 950 000 0.250% Spain Government Bond 30/07/2024                   | 997 014          | 0,04              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                     |                  |                   | <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 1 050 000 2.750% Spain Government Bond<br>31/10/2024              | 1 138 069        | 0,04              | 1 350 000 0.100% Spain Government Bond<br>30/04/2031              | 1 155 149        | 0,04              |
| 1 050 000 0.000% Spain Government Bond<br>31/01/2025              | 1 083 825        | 0,04              | 1 000 000 0.500% Spain Government Bond<br>31/10/2031              | 872 126          | 0,03              |
| 1 300 000 1.600% Spain Government Bond<br>30/04/2025              | 1 377 315        | 0,05              | 1 100 000 0.700% Spain Government Bond<br>30/04/2032              | 962 302          | 0,04              |
| 1 000 000 0.000% Spain Government Bond<br>31/05/2025              | 1 021 100        | 0,04              | 425 000 5.750% Spain Government Bond<br>30/07/2032                | 556 357          | 0,02              |
| 1 500 000 4.650% Spain Government Bond<br>30/07/2025              | 1 695 318        | 0,06              | 1 800 000 2.550% Spain Government Bond<br>31/10/2032              | 1 843 534        | 0,07              |
| 1 050 000 2.150% Spain Government Bond<br>31/10/2025              | 1 123 307        | 0,04              | 1 200 000 3.150% Spain Government Bond<br>30/04/2033              | 1 284 966        | 0,05              |
| 1 700 000 0.000% Spain Government Bond<br>31/01/2026              | 1 704 619        | 0,07              | 900 000 2.350% Spain Government Bond<br>30/07/2033                | 896 442          | 0,03              |
| 998 000 1.950% Spain Government Bond<br>30/04/2026                | 1 055 847        | 0,04              | 650 000 1.850% Spain Government Bond<br>30/07/2035                | 594 219          | 0,02              |
| 666 000 5.900% Spain Government Bond<br>30/07/2026                | 792 011          | 0,03              | 790 000 4.200% Spain Government Bond<br>31/01/2037                | 918 977          | 0,04              |
| 1 343 000 1.300% Spain Government Bond<br>31/10/2026              | 1 383 696        | 0,05              | 900 000 0.850% Spain Government Bond<br>30/07/2037                | 681 823          | 0,03              |
| 1 000 000 0.000% Spain Government Bond<br>31/01/2027              | 973 850          | 0,04              | 590 000 4.900% Spain Government Bond<br>30/07/2040                | 742 669          | 0,03              |
| 855 000 1.500% Spain Government Bond<br>30/04/2027                | 879 933          | 0,03              | 1 000 000 1.200% Spain Government Bond<br>31/10/2040              | 741 144          | 0,03              |
| 950 000 0.800% Spain Government Bond<br>30/07/2027                | 945 047          | 0,04              | 785 000 4.700% Spain Government Bond<br>30/07/2041                | 966 703          | 0,04              |
| 1 265 000 1.450% Spain Government Bond<br>31/10/2027              | 1 289 094        | 0,05              | 650 000 1.000% Spain Government Bond<br>30/07/2042                | 447 670          | 0,02              |
| 550 000 0.000% Spain Government Bond<br>31/01/2028                | 519 287          | 0,02              | 450 000 3.450% Spain Government Bond<br>30/07/2043                | 467 244          | 0,02              |
| 1 150 000 1.400% Spain Government Bond<br>30/04/2028              | 1 159 284        | 0,04              | 425 000 5.150% Spain Government Bond<br>31/10/2044                | 559 423          | 0,02              |
| 1 159 000 1.400% Spain Government Bond<br>30/07/2028              | 1 164 365        | 0,04              | 900 000 2.900% Spain Government Bond<br>31/10/2046                | 856 479          | 0,03              |
| 1 000 000 5.150% Spain Government Bond<br>31/10/2028              | 1 205 362        | 0,05              | 846 000 2.700% Spain Government Bond<br>31/10/2048                | 763 867          | 0,03              |
| 450 000 6.000% Spain Government Bond<br>31/01/2029                | 567 371          | 0,02              | 950 000 1.000% Spain Government Bond<br>31/10/2050                | 554 211          | 0,02              |
| 1 289 000 1.450% Spain Government Bond<br>30/04/2029              | 1 282 825        | 0,05              | 500 000 1.900% Spain Government Bond<br>31/10/2052                | 360 625          | 0,01              |
| 700 000 0.800% Spain Government Bond<br>30/07/2029                | 663 770          | 0,03              | 525 000 3.450% Spain Government Bond<br>30/07/2066                | 524 966          | 0,02              |
| 1 051 000 0.600% Spain Government Bond<br>31/10/2029              | 980 035          | 0,04              | 300 000 1.450% Spain Government Bond<br>31/10/2071                | 158 972          | 0,01              |
| 975 000 0.500% Spain Government Bond<br>30/04/2030                | 890 396          | 0,03              | 50 000 1.625% State of Brandenburg<br>28/05/2024                  | 53 304           | 0,00              |
| 1 250 000 1.950% Spain Government Bond<br>30/07/2030              | 1 260 431        | 0,05              | 100 000 0.250% State of Brandenburg<br>19/10/2026                 | 98 612           | 0,00              |
| 1 000 000 1.250% Spain Government Bond<br>31/10/2030              | 953 762          | 0,04              | 50 000 1.125% State of Brandenburg<br>04/07/2033                  | 45 443           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 200 000 0.125% State of Brandenburg 26/01/2046                    | 110 783          | 0,01              |
| 300 000 0.010% State of Bremen 06/10/2028                         | 277 609          | 0,01              |
| 50 000 1.500% State of Bremen 12/11/2038                          | 42 875           | 0,00              |
| 50 000 0.400% State of Bremen 20/08/2049                          | 27 713           | 0,00              |
| 100 000 0.000% State of Hesse 10/03/2025                          | 102 228          | 0,00              |
| 100 000 0.250% State of Hesse 10/06/2025                          | 102 063          | 0,00              |
| 100 000 0.000% State of Hesse 14/04/2026                          | 99 114           | 0,00              |
| 100 000 0.375% State of Hesse 06/07/2026                          | 99 737           | 0,00              |
| 100 000 0.625% State of Hesse 07/04/2027                          | 98 997           | 0,00              |
| 100 000 1.750% State of Hesse 05/07/2027                          | 103 326          | 0,00              |
| 100 000 2.625% State of Hesse 10/09/2027                          | 107 139          | 0,01              |
| 100 000 0.625% State of Hesse 02/08/2028                          | 96 334           | 0,00              |
| 200 000 0.010% State of Hesse 11/03/2030                          | 177 667          | 0,01              |
| 100 000 2.875% State of Hesse 10/01/2033                          | 108 068          | 0,01              |
| 200 000 0.010% State of Lower Saxony 15/04/2024                   | 210 215          | 0,01              |
| 100 000 0.125% State of Lower Saxony 07/03/2025                   | 102 560          | 0,00              |
| 100 000 0.500% State of Lower Saxony 13/06/2025                   | 102 646          | 0,00              |
| 100 000 0.000% State of Lower Saxony 15/09/2025                   | 100 788          | 0,00              |
| 100 000 0.000% State of Lower Saxony 11/02/2027                   | 96 862           | 0,00              |
| 100 000 0.750% State of Lower Saxony 15/02/2028                   | 97 836           | 0,00              |
| 200 000 0.010% State of Lower Saxony 16/06/2028                   | 186 624          | 0,01              |
| 200 000 0.010% State of Lower Saxony 10/01/2031                   | 173 393          | 0,01              |
| 300 000 2.750% State of Lower Saxony 17/02/2031                   | 321 525          | 0,01              |
| 100 000 0.125% State of Lower Saxony 09/01/2032                   | 85 152           | 0,00              |
| 200 000 3.000% State of Lower Saxony 10/01/2033                   | 218 266          | 0,01              |
| 100 000 1.125% State of Lower Saxony 12/09/2033                   | 90 626           | 0,00              |
| 300 000 1.250% State of North Rhine-Westphalia Germany 14/03/2025 | 314 107          | 0,01              |
| 200 000 0.000% State of North Rhine-Westphalia Germany 05/05/2025 | 203 720          | 0,01              |
| 300 000 0.250% State of North Rhine-Westphalia Germany 13/03/2026 | 300 391          | 0,01              |
| 200 000 0.200% State of North Rhine-Westphalia Germany 31/03/2027 | 194 546          | 0,01              |
| 200 000 3.000% State of North Rhine-Westphalia Germany 27/01/2028 | 217 614          | 0,01              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                     |                  |                   |
| 100 000 0.000% State of North Rhine-Westphalia Germany 15/01/2029 | 91 897           | 0,00              |
| 50 000 0.000% State of North Rhine-Westphalia Germany 26/11/2029  | 44 804           | 0,00              |
| 200 000 0.200% State of North Rhine-Westphalia Germany 09/04/2030 | 180 027          | 0,01              |
| 200 000 2.750% State of North Rhine-Westphalia Germany 15/01/2032 | 214 259          | 0,01              |
| 100 000 2.000% State of North Rhine-Westphalia Germany 15/06/2032 | 100 353          | 0,00              |
| 50 000 2.375% State of North Rhine-Westphalia Germany 13/05/2033  | 51 441           | 0,00              |
| 50 000 1.100% State of North Rhine-Westphalia Germany 13/03/2034  | 44 599           | 0,00              |
| 200 000 0.000% State of North Rhine-Westphalia Germany 12/10/2035 | 147 672          | 0,01              |
| 200 000 1.650% State of North Rhine-Westphalia Germany 22/02/2038 | 177 941          | 0,01              |
| 100 000 0.500% State of North Rhine-Westphalia Germany 25/11/2039 | 70 952           | 0,00              |
| 150 000 1.500% State of North Rhine-Westphalia Germany 12/06/2040 | 126 350          | 0,01              |
| 100 000 0.600% State of North Rhine-Westphalia Germany 04/06/2041 | 69 456           | 0,00              |
| 150 000 1.650% State of North Rhine-Westphalia Germany 16/05/2047 | 121 936          | 0,01              |
| 100 000 1.550% State of North Rhine-Westphalia Germany 16/06/2048 | 79 015           | 0,00              |
| 100 000 0.800% State of North Rhine-Westphalia Germany 30/07/2049 | 63 424           | 0,00              |
| 150 000 0.375% State of North Rhine-Westphalia Germany 02/09/2050 | 80 964           | 0,00              |
| 100 000 0.200% State of North Rhine-Westphalia Germany 27/01/2051 | 50 049           | 0,00              |
| 200 000 0.500% State of North Rhine-Westphalia Germany 15/01/2052 | 110 561          | 0,01              |
| 100 000 2.250% State of North Rhine-Westphalia Germany 14/06/2052 | 91 337           | 0,00              |
| 100 000 1.750% State of North Rhine-Westphalia Germany 26/10/2057 | 77 109           | 0,00              |
| 100 000 1.750% State of North Rhine-Westphalia Germany 11/07/2068 | 70 933           | 0,00              |
| 120 000 1.950% State of North Rhine-Westphalia Germany 26/09/2078 | 91 189           | 0,00              |
| 125 000 2.150% State of North Rhine-Westphalia Germany 21/03/2119 | 95 777           | 0,00              |
| 100 000 1.375% State of North Rhine-Westphalia Germany 15/01/2120 | 54 067           | 0,00              |
| 100 000 0.950% State of North Rhine-Westphalia Germany 10/01/2121 | 43 189           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 13,30 % (suite)</b>                                     |                  |                   | <b>Forint hongrois – 0,05 %</b>                                   |                  |                   |
| 50 000 1.450% State of North Rhine-Westphalia Germany 19/01/2122  | 27 874           | 0,00              | 50 000 000 1.500% Hungary Government Bond 22/04/2026              | 109 959          | 0,00              |
| 100 000 0.010% State of Rhineland-Palatinate 17/03/2025           | 102 191          | 0,00              | 10 000 000 2.750% Hungary Government Bond 22/12/2026              | 22 183           | 0,00              |
| 100 000 0.700% State of Rhineland-Palatinate 26/01/2028           | 97 695           | 0,00              | 50 000 000 3.000% Hungary Government Bond 27/10/2027              | 108 588          | 0,00              |
| 100 000 0.050% State of Rhineland-Palatinate 23/01/2030           | 89 522           | 0,00              | 110 000 000 4.500% Hungary Government Bond 23/03/2028             | 254 968          | 0,01              |
| 100 000 0.375% State of Rhineland-Palatinate 10/03/2051           | 53 494           | 0,00              | 100 000 000 2.000% Hungary Government Bond 23/05/2029             | 195 684          | 0,01              |
| 100 000 1.500% State of Rhineland-Palatinate 25/04/2052           | 75 663           | 0,00              | 80 000 000 3.000% Hungary Government Bond 21/08/2030              | 161 001          | 0,01              |
| 100 000 0.050% State of Saarland 05/11/2040                       | 63 291           | 0,00              | 100 000 000 3.250% Hungary Government Bond 22/10/2031             | 196 578          | 0,01              |
| 100 000 0.000% State of Saxony-Anhalt 01/04/2025                  | 102 013          | 0,00              | 100 000 000 2.250% Hungary Government Bond 20/04/2033             | 170 912          | 0,01              |
| 100 000 0.750% State of Saxony-Anhalt 29/01/2029                  | 96 072           | 0,00              | 50 000 000 3.000% Hungary Government Bond 27/10/2038              | 79 061           | 0,00              |
| 100 000 0.000% State of Saxony-Anhalt 10/03/2031                  | 86 275           | 0,00              |   | <b>1 298 934</b> | <b>0,05</b>       |
| 100 000 0.500% State of Saxony-Anhalt 24/03/2051                  | 56 322           | 0,00              | <b>Roupie indonésienne – 0,40 %</b>                               |                  |                   |
| 100 000 0.010% State of Schleswig-Holstein Germany 16/07/2025     | 101 247          | 0,00              | 8 000 000 000 6.500% Indonesia Treasury Bond 15/06/2025           | 536 197          | 0,02              |
| 100 000 0.375% State of Schleswig-Holstein Germany 08/02/2027     | 98 336           | 0,00              | 5 000 000 000 5.500% Indonesia Treasury Bond 15/04/2026           | 326 266          | 0,01              |
| 200 000 1.375% State of Schleswig-Holstein Germany 14/07/2027     | 203 383          | 0,01              | 7 200 000 000 8.375% Indonesia Treasury Bond 15/09/2026           | 508 497          | 0,02              |
| 100 000 0.250% State of Schleswig-Holstein Germany 18/04/2028     | 95 019           | 0,00              | 11 000 000 000 5.125% Indonesia Treasury Bond 15/04/2027          | 704 442          | 0,03              |
| 100 000 2.375% State of Schleswig-Holstein Germany 22/09/2032     | 103 389          | 0,00              | 1 200 000 000 7.000% Indonesia Treasury Bond 15/05/2027           | 81 865           | 0,00              |
| 200 000 1.375% State of the Grand-Duchy of Luxembourg 25/05/2029  | 199 090          | 0,01              | 1 200 000 000 6.125% Indonesia Treasury Bond 15/05/2028           | 79 005           | 0,00              |
| 100 000 0.000% State of the Grand-Duchy of Luxembourg 24/03/2031  | 86 492           | 0,00              | 13 000 000 000 6.375% Indonesia Treasury Bond 15/08/2028          | 866 542          | 0,03              |
| 100 000 2.375% UNEDIC ASSEO 25/05/2024                            | 107 393          | 0,01              | 2 000 000 000 9.000% Indonesia Treasury Bond 15/03/2029           | 149 576          | 0,01              |
| 100 000 0.625% UNEDIC ASSEO 17/02/2025                            | 103 719          | 0,00              | 4 000 000 000 8.250% Indonesia Treasury Bond 15/05/2029           | 289 869          | 0,01              |
| 200 000 0.100% UNEDIC ASSEO 25/11/2026                            | 195 685          | 0,01              | 10 000 000 000 7.000% Indonesia Treasury Bond 15/09/2030          | 681 930          | 0,03              |
| 200 000 1.250% UNEDIC ASSEO 28/03/2027                            | 203 166          | 0,01              | 13 000 000 000 6.500% Indonesia Treasury Bond 15/02/2031          | 861 843          | 0,03              |
| 200 000 0.000% UNEDIC ASSEO 25/11/2028                            | 184 208          | 0,01              | 21 000 000 000 6.375% Indonesia Treasury Bond 15/04/2032          | 1 372 881        | 0,05              |
| 200 000 0.500% UNEDIC ASSEO 20/03/2029                            | 188 773          | 0,01              | 850 000 000 7.500% Indonesia Treasury Bond 15/08/2032             | 59 448           | 0,00              |
| 200 000 0.250% UNEDIC ASSEO 25/11/2029                            | 182 502          | 0,01              | 15 000 000 000 7.000% Indonesia Treasury Bond 15/02/2033          | 1 016 723        | 0,04              |
| 200 000 0.010% UNEDIC ASSEO 25/05/2031                            | 171 939          | 0,01              | 1 750 000 000 6.625% Indonesia Treasury Bond 15/05/2033           | 115 175          | 0,01              |
| 200 000 0.010% UNEDIC ASSEO 25/11/2031                            | 168 754          | 0,01              |   |                  |                   |
| 100 000 1.750% UNEDIC ASSEO 25/11/2032                            | 97 147           | 0,00              |   |                  |                   |
| 200 000 0.100% UNEDIC ASSEO 25/05/2034                            | 155 069          | 0,01              |   |                  |                   |
| 200 000 0.250% UNEDIC ASSEO 16/07/2035                            | 152 503          | 0,01              |   |                  |                   |
| 200 000 0.500% UNEDIC ASSEO 25/05/2036                            | 152 507          | 0,01              |   |                  |                   |
| <b>354 207 842</b>  | <b>13,30</b>     |                   |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                   |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                   |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Roupie indonésienne – 0,40 % (suite)</b>                       |                   |                   | <b>Yen japonais – 11,88 % (suite)</b>                             |                  |                   |
| 4 500 000 000 8.375% Indonesia Treasury Bond<br>15/03/2034        | 332 960           | 0,01              | 640 000 000 0.100% Japan Government Five Year<br>Bond 20/06/2025  | 4 827 915        | 0,18              |
| 4 400 000 000 7.500% Indonesia Treasury Bond<br>15/06/2035        | 306 749           | 0,01              | 450 000 000 0.100% Japan Government Five Year<br>Bond 20/09/2025  | 3 395 473        | 0,13              |
| 1 000 000 000 8.250% Indonesia Treasury Bond<br>15/05/2036        | 73 710            | 0,00              | 629 700 000 0.100% Japan Government Five Year<br>Bond 20/12/2025  | 4 752 818        | 0,18              |
| 850 000 000 7.500% Indonesia Treasury Bond<br>15/05/2038          | 59 227            | 0,00              | 675 000 000 0.005% Japan Government Five Year<br>Bond 20/03/2026  | 5 081 088        | 0,19              |
| 650 000 000 10.500% Indonesia Treasury Bond<br>15/07/2038         | 57 433            | 0,00              | 650 000 000 0.005% Japan Government Five Year<br>Bond 20/06/2026  | 4 891 337        | 0,18              |
| 6 000 000 000 8.375% Indonesia Treasury Bond<br>15/04/2039        | 450 353           | 0,02              | 711 400 000 0.005% Japan Government Five Year<br>Bond 20/09/2026  | 5 350 333        | 0,20              |
| 6 000 000 000 7.500% Indonesia Treasury Bond<br>15/04/2040        | 417 709           | 0,02              | 750 000 000 0.005% Japan Government Five Year<br>Bond 20/12/2026  | 5 635 735        | 0,21              |
| 11 500 000 000 7.125% Indonesia Treasury Bond<br>15/06/2042       | 774 610           | 0,03              | 650 000 000 0.005% Japan Government Five Year<br>Bond 20/03/2027  | 4 880 494        | 0,18              |
| 5 000 000 000 7.125% Indonesia Treasury Bond<br>15/06/2043        | 337 237           | 0,01              | 615 000 000 0.100% Japan Government Five Year<br>Bond 20/03/2027  | 4 635 813        | 0,17              |
| 4 000 000 000 7.375% Indonesia Treasury Bond<br>15/05/2048        | 273 740           | 0,01              | 825 000 000 0.005% Japan Government Five Year<br>Bond 20/06/2027  | 6 189 205        | 0,23              |
|   | <b>10 733 987</b> | <b>0,40</b>       | 845 100 000 0.100% Japan Government Five Year<br>Bond 20/09/2027  | 6 360 951        | 0,24              |
| <b>Nouveau shekel israélien – 0,09 %</b>                          |                   |                   | 200 000 000 0.300% Japan Government Five Year<br>Bond 20/12/2027  | 1 518 371        | 0,06              |
| 1 000 000 0.500% Israel Government Bond - Fixed<br>30/04/2025     | 258 409           | 0,01              | 36 200 000 2.400% Japan Government Forty Year<br>Bond 20/03/2048  | 343 461          | 0,01              |
| 500 000 1.750% Israel Government Bond - Fixed<br>31/08/2025       | 131 712           | 0,01              | 15 000 000 2.200% Japan Government Forty Year<br>Bond 20/03/2049  | 137 321          | 0,01              |
| 1 250 000 0.500% Israel Government Bond - Fixed<br>27/02/2026     | 314 711           | 0,01              | 75 900 000 2.200% Japan Government Forty Year<br>Bond 20/03/2051  | 695 150          | 0,03              |
| 1 200 000 2.000% Israel Government Bond - Fixed<br>31/03/2027     | 311 331           | 0,01              | 30 000 000 2.000% Japan Government Forty Year<br>Bond 20/03/2052  | 265 100          | 0,01              |
| 700 000 2.250% Israel Government Bond - Fixed<br>28/09/2028       | 180 079           | 0,01              | 25 000 000 1.700% Japan Government Forty Year<br>Bond 20/03/2054  | 207 482          | 0,01              |
| 1 550 000 1.000% Israel Government Bond - Fixed<br>31/03/2030     | 358 889           | 0,01              | 50 500 000 1.400% Japan Government Forty Year<br>Bond 20/03/2055  | 390 264          | 0,01              |
| 1 250 000 1.500% Israel Government Bond - Fixed<br>31/05/2037     | 256 950           | 0,01              | 120 000 000 0.400% Japan Government Forty Year<br>Bond 20/03/2056 | 685 233          | 0,03              |
| 950 000 5.500% Israel Government Bond - Fixed<br>31/01/2042       | 315 620           | 0,01              | 81 300 000 0.900% Japan Government Forty Year<br>Bond 20/03/2057  | 544 843          | 0,02              |
| 1 125 000 3.750% Israel Government Bond - Fixed<br>31/03/2047     | 298 274           | 0,01              | 102 000 000 0.800% Japan Government Forty Year<br>Bond 20/03/2058 | 657 892          | 0,02              |
|   | <b>2 425 975</b>  | <b>0,09</b>       | 130 700 000 0.500% Japan Government Forty Year<br>Bond 20/03/2059 | 755 141          | 0,03              |
| <b>Yen japonais – 11,88 %</b>                                     |                   |                   | 241 850 000 0.500% Japan Government Forty Year<br>Bond 20/03/2060 | 1 391 496        | 0,05              |
| 300 000 000 0.100% Japan Government Five Year<br>Bond 20/06/2024  | 2 260 155         | 0,09              | 172 050 000 0.700% Japan Government Forty Year<br>Bond 20/03/2061 | 1 057 857        | 0,04              |
| 490 000 000 0.100% Japan Government Five Year<br>Bond 20/09/2024  | 3 692 691         | 0,14              | 291 900 000 1.000% Japan Government Forty Year<br>Bond 20/03/2062 | 1 959 278        | 0,07              |
| 400 000 000 0.100% Japan Government Five Year<br>Bond 20/12/2024  | 3 015 674         | 0,11              |   |                  |                   |
| 627 000 000 0.100% Japan Government Five Year<br>Bond 20/03/2025  | 4 728 623         | 0,18              |   |                  |                   |



## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Partici-<br>pation Investissement                                 | Juste valeur<br>USD | % des<br>actifs<br>nets | Partici-<br>pation Investissement                                 | Juste valeur<br>USD | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                     |                         | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                     |                         | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Yen japonais – 11,88 % (suite)</b>                             |                     |                         | <b>Yen japonais – 11,88 % (suite)</b>                             |                     |                         |
| 240 700 000 0.600% Japan Government Ten Year Bond 20/06/2024      | 1 824 375           | 0,07                    | 688 400 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/09/2030      | 5 117 560           | 0,19                    |
| 313 450 000 0.500% Japan Government Ten Year Bond 20/09/2024      | 2 376 016           | 0,09                    | 550 000 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/12/2030      | 4 076 257           | 0,15                    |
| 83 500 000 0.300% Japan Government Ten Year Bond 20/12/2024       | 631 686             | 0,02                    | 610 000 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/03/2031      | 4 511 497           | 0,17                    |
| 40 000 000 0.500% Japan Government Ten Year Bond 20/12/2024       | 303 635             | 0,01                    | 365 500 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/06/2031      | 2 698 147           | 0,10                    |
| 112 500 000 0.400% Japan Government Ten Year Bond 20/03/2025      | 853 340             | 0,03                    | 480 000 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/09/2031      | 3 543 142           | 0,13                    |
| 105 000 000 0.400% Japan Government Ten Year Bond 20/06/2025      | 797 303             | 0,03                    | 757 300 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/12/2031      | 5 586 290           | 0,21                    |
| 100 000 000 0.400% Japan Government Ten Year Bond 20/09/2025      | 760 268             | 0,03                    | 832 500 000 0.200% Japan Government Ten Year Bond 20/03/2032      | 6 202 935           | 0,23                    |
| 135 350 000 0.300% Japan Government Ten Year Bond 20/12/2025      | 1 027 446           | 0,04                    | 885 000 000 0.200% Japan Government Ten Year Bond 20/06/2032      | 6 625 963           | 0,25                    |
| 180 000 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/03/2026      | 1 358 960           | 0,05                    | 950 000 000 0.200% Japan Government Ten Year Bond 20/09/2032      | 7 162 153           | 0,27                    |
| 257 350 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/06/2026      | 1 943 032           | 0,07                    | 50 000 000 0.500% Japan Government Ten Year Bond 20/12/2032       | 381 836             | 0,01                    |
| 234 800 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/09/2026      | 1 772 194           | 0,07                    | 37 550 000 1.700% Japan Government Thirty Year Bond 20/06/2033    | 317 405             | 0,01                    |
| 276 200 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/12/2026      | 2 083 298           | 0,08                    | 75 000 000 2.000% Japan Government Thirty Year Bond 20/12/2033    | 652 842             | 0,02                    |
| 237 200 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/03/2027      | 1 787 813           | 0,07                    | 70 000 000 2.500% Japan Government Thirty Year Bond 20/06/2034    | 637 321             | 0,02                    |
| 158 000 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/06/2027      | 1 190 348           | 0,04                    | 30 000 000 2.500% Japan Government Thirty Year Bond 20/09/2034    | 274 520             | 0,01                    |
| 312 450 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/09/2027      | 2 351 721           | 0,09                    | 35 000 000 2.400% Japan Government Thirty Year Bond 20/12/2034    | 317 191             | 0,01                    |
| 315 000 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/12/2027      | 2 369 376           | 0,09                    | 31 050 000 2.300% Japan Government Thirty Year Bond 20/06/2035    | 279 728             | 0,01                    |
| 398 000 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/03/2028      | 2 991 355           | 0,11                    | 45 000 000 2.500% Japan Government Thirty Year Bond 20/09/2035    | 413 811             | 0,02                    |
| 230 550 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/06/2028      | 1 731 940           | 0,07                    | 68 650 000 2.500% Japan Government Thirty Year Bond 20/06/2036    | 635 506             | 0,02                    |
| 325 000 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/09/2028      | 2 439 734           | 0,09                    | 35 000 000 2.300% Japan Government Thirty Year Bond 20/12/2036    | 317 795             | 0,01                    |
| 406 300 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/12/2028      | 3 048 090           | 0,11                    | 25 000 000 2.500% Japan Government Thirty Year Bond 20/09/2037    | 232 812             | 0,01                    |
| 248 350 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/03/2029      | 1 861 608           | 0,07                    | 85 000 000 2.400% Japan Government Thirty Year Bond 20/09/2038    | 788 746             | 0,03                    |
| 453 450 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/06/2029      | 3 394 930           | 0,13                    | 40 000 000 2.200% Japan Government Thirty Year Bond 20/09/2039    | 361 028             | 0,01                    |
| 890 400 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/12/2029      | 6 647 994           | 0,25                    | 36 800 000 2.300% Japan Government Thirty Year Bond 20/03/2040    | 336 879             | 0,01                    |
| 563 000 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/03/2030      | 4 199 255           | 0,16                    | 36 250 000 2.000% Japan Government Thirty Year Bond 20/09/2040    | 318 591             | 0,01                    |
| 530 000 000 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/06/2030      | 3 946 148           | 0,15                    | 55 000 000 2.200% Japan Government Thirty Year Bond 20/03/2041    | 497 025             | 0,02                    |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Yen japonais – 11,88 % (suite)</b>                             |                  |                   | <b>Yen japonais – 11,88 % (suite)</b>                             |                  |                   |
| 71 100 000 2.000% Japan Government Thirty Year Bond 20/09/2041    | 625 893          | 0,02              | 120 000 000 0.700% Japan Government Thirty Year Bond 20/12/2048   | 800 724          | 0,03              |
| 85 000 000 2.000% Japan Government Thirty Year Bond 20/03/2042    | 748 803          | 0,03              | 160 000 000 0.500% Japan Government Thirty Year Bond 20/03/2049   | 1 010 384        | 0,04              |
| 146 050 000 1.900% Japan Government Thirty Year Bond 20/09/2042   | 1 269 073        | 0,05              | 155 650 000 0.400% Japan Government Thirty Year Bond 20/06/2049   | 953 127          | 0,04              |
| 152 150 000 1.800% Japan Government Thirty Year Bond 20/03/2043   | 1 297 444        | 0,05              | 85 000 000 0.400% Japan Government Thirty Year Bond 20/09/2049    | 519 018          | 0,02              |
| 37 300 000 1.800% Japan Government Thirty Year Bond 20/09/2043    | 318 411          | 0,01              | 155 000 000 0.400% Japan Government Thirty Year Bond 20/12/2049   | 944 767          | 0,04              |
| 50 000 000 1.700% Japan Government Thirty Year Bond 20/12/2043    | 419 757          | 0,02              | 120 000 000 0.400% Japan Government Thirty Year Bond 20/03/2050   | 727 366          | 0,03              |
| 78 000 000 1.700% Japan Government Thirty Year Bond 20/03/2044    | 654 798          | 0,02              | 145 000 000 0.600% Japan Government Thirty Year Bond 20/06/2050   | 925 727          | 0,04              |
| 71 950 000 1.700% Japan Government Thirty Year Bond 20/06/2044    | 603 939          | 0,02              | 120 000 000 0.600% Japan Government Thirty Year Bond 20/09/2050   | 764 595          | 0,03              |
| 42 000 000 1.700% Japan Government Thirty Year Bond 20/09/2044    | 352 388          | 0,01              | 122 200 000 0.700% Japan Government Thirty Year Bond 20/12/2050   | 798 638          | 0,03              |
| 40 000 000 1.500% Japan Government Thirty Year Bond 20/12/2044    | 324 127          | 0,01              | 170 000 000 0.700% Japan Government Thirty Year Bond 20/03/2051   | 1 108 826        | 0,04              |
| 76 800 000 1.500% Japan Government Thirty Year Bond 20/03/2045    | 622 011          | 0,02              | 190 000 000 0.700% Japan Government Thirty Year Bond 20/06/2051   | 1 236 877        | 0,05              |
| 110 000 000 1.600% Japan Government Thirty Year Bond 20/06/2045   | 906 630          | 0,03              | 175 000 000 0.700% Japan Government Thirty Year Bond 20/09/2051   | 1 139 492        | 0,04              |
| 64 650 000 1.400% Japan Government Thirty Year Bond 20/09/2045    | 513 324          | 0,02              | 280 000 000 0.700% Japan Government Thirty Year Bond 20/12/2051   | 1 818 811        | 0,07              |
| 150 000 000 1.400% Japan Government Thirty Year Bond 20/12/2045   | 1 189 687        | 0,04              | 195 000 000 1.000% Japan Government Thirty Year Bond 20/03/2052   | 1 371 168        | 0,05              |
| 73 650 000 0.800% Japan Government Thirty Year Bond 20/03/2046    | 517 509          | 0,02              | 170 000 000 1.300% Japan Government Thirty Year Bond 20/06/2052   | 1 285 583        | 0,05              |
| 92 050 000 0.300% Japan Government Thirty Year Bond 20/06/2046    | 575 504          | 0,02              | 210 000 000 1.400% Japan Government Thirty Year Bond 20/09/2052   | 1 628 514        | 0,06              |
| 118 000 000 0.500% Japan Government Thirty Year Bond 20/09/2046   | 771 934          | 0,03              | 40 000 000 1.600% Japan Government Thirty Year Bond 20/12/2052    | 324 728          | 0,01              |
| 122 000 000 0.600% Japan Government Thirty Year Bond 20/12/2046   | 814 739          | 0,03              | 50 000 000 2.200% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2024    | 386 287          | 0,01              |
| 47 900 000 0.800% Japan Government Thirty Year Bond 20/03/2047    | 333 943          | 0,01              | 34 050 000 2.400% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2024    | 263 719          | 0,01              |
| 50 000 000 0.800% Japan Government Thirty Year Bond 20/06/2047    | 347 697          | 0,01              | 50 000 000 2.000% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2024    | 389 267          | 0,01              |
| 104 350 000 0.800% Japan Government Thirty Year Bond 20/09/2047   | 723 935          | 0,03              | 50 000 000 2.100% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2024    | 389 913          | 0,01              |
| 173 300 000 0.800% Japan Government Thirty Year Bond 20/12/2047   | 1 199 376        | 0,05              | 50 000 000 1.900% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2025    | 392 141          | 0,02              |
| 125 150 000 0.800% Japan Government Thirty Year Bond 20/03/2048   | 862 763          | 0,03              | 20 000 000 2.000% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2025    | 157 187          | 0,01              |
| 57 000 000 0.700% Japan Government Thirty Year Bond 20/06/2048    | 382 644          | 0,01              | 50 000 000 2.000% Japan Government Twenty Year Bond 20/09/2025    | 394 921          | 0,02              |
| 139 200 000 0.900% Japan Government Thirty Year Bond 20/09/2048   | 976 942          | 0,04              | 25 300 000 2.100% Japan Government Twenty Year Bond 20/09/2025    | 200 294          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Yen japonais – 11,88 % (suite)</b>                             |                  |                   | <b>Yen japonais – 11,88 % (suite)</b>                             |                  |                   |
| 20 000 000 2.000% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2025    | 158 691          | 0,01              | 101 000 000 1.600% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2030   | 833 673          | 0,03              |
| 73 950 000 2.100% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2025    | 588 238          | 0,02              | 24 300 000 1.800% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2030    | 203 146          | 0,01              |
| 74 600 000 2.100% Japan Government Twenty Year Bond 20/03/2026    | 596 324          | 0,02              | 75 000 000 1.900% Japan Government Twenty Year Bond 20/09/2030    | 633 226          | 0,02              |
| 180 000 000 2.200% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2026   | 1 450 495        | 0,05              | 3 650 000 2.200% Japan Government Twenty Year Bond 20/03/2031     | 31 533           | 0,00              |
| 22 100 000 2.300% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2026    | 178 632          | 0,01              | 15 000 000 1.900% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2031    | 127 197          | 0,01              |
| 21 200 000 2.200% Japan Government Twenty Year Bond 20/09/2026    | 171 588          | 0,01              | 29 000 000 1.800% Japan Government Twenty Year Bond 20/09/2031    | 244 815          | 0,01              |
| 50 000 000 2.300% Japan Government Twenty Year Bond 20/09/2026    | 405 955          | 0,02              | 18 000 000 1.700% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2031    | 151 325          | 0,01              |
| 69 900 000 2.100% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2026    | 566 206          | 0,02              | 97 700 000 1.800% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2031    | 827 671          | 0,03              |
| 15 600 000 2.000% Japan Government Twenty Year Bond 20/03/2027    | 126 393          | 0,01              | 20 000 000 1.800% Japan Government Twenty Year Bond 20/03/2032    | 169 990          | 0,01              |
| 60 450 000 2.300% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2027    | 497 312          | 0,02              | 45 000 000 1.500% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2032    | 373 684          | 0,01              |
| 38 800 000 2.200% Japan Government Twenty Year Bond 20/09/2027    | 319 268          | 0,01              | 20 000 000 1.700% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2032    | 168 997          | 0,01              |
| 80 000 000 2.100% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2027    | 658 231          | 0,02              | 78 000 000 1.700% Japan Government Twenty Year Bond 20/09/2032    | 659 065          | 0,03              |
| 30 000 000 2.200% Japan Government Twenty Year Bond 20/03/2028    | 248 908          | 0,01              | 65 000 000 1.700% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2032    | 549 372          | 0,02              |
| 27 350 000 2.300% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2028    | 229 020          | 0,01              | 45 000 000 1.800% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2032    | 383 590          | 0,01              |
| 64 500 000 2.400% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2028    | 542 621          | 0,02              | 40 000 000 1.500% Japan Government Twenty Year Bond 20/03/2033    | 332 295          | 0,01              |
| 45 000 000 2.200% Japan Government Twenty Year Bond 20/09/2028    | 376 625          | 0,01              | 50 000 000 1.600% Japan Government Twenty Year Bond 20/03/2033    | 418 574          | 0,02              |
| 100 000 000 1.900% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2028   | 826 989          | 0,03              | 122 450 000 1.700% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2033   | 1 034 766        | 0,04              |
| 25 000 000 1.900% Japan Government Twenty Year Bond 20/03/2029    | 207 546          | 0,01              | 375 000 000 1.700% Japan Government Twenty Year Bond 20/09/2033   | 3 171 792        | 0,12              |
| 68 850 000 2.100% Japan Government Twenty Year Bond 20/03/2029    | 577 442          | 0,02              | 145 000 000 1.600% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2033   | 1 215 499        | 0,05              |
| 67 000 000 2.100% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2029    | 563 673          | 0,02              | 71 350 000 1.500% Japan Government Twenty Year Bond 20/03/2034    | 592 984          | 0,02              |
| 50 000 000 2.100% Japan Government Twenty Year Bond 20/09/2029    | 422 511          | 0,02              | 70 000 000 1.500% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2034    | 581 706          | 0,02              |
| 136 950 000 2.100% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2029   | 1 159 707        | 0,04              | 124 200 000 1.400% Japan Government Twenty Year Bond 20/09/2034   | 1 022 268        | 0,04              |
| 38 000 000 2.200% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2029    | 323 652          | 0,01              | 52 500 000 1.200% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2034    | 421 941          | 0,02              |
| 40 000 000 2.100% Japan Government Twenty Year Bond 20/03/2030    | 339 737          | 0,01              | 251 250 000 1.200% Japan Government Twenty Year Bond 20/03/2035   | 2 021 233        | 0,08              |
| 56 600 000 2.200% Japan Government Twenty Year Bond 20/03/2030    | 483 764          | 0,02              | 75 000 000 1.300% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2035    | 609 822          | 0,02              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Yen japonais – 11,88 % (suite)</b>                             |                  |                   | <b>Yen japonais – 11,88 % (suite)</b>                             |                  |                   |
| 83 000 000 1.200% Japan Government Twenty Year Bond 20/09/2035    | 666 813          | 0,03              | 350 000 000 0.500% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2041   | 2 410 500        | 0,09              |
| 171 000 000 1.000% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2035   | 1 346 851        | 0,05              | 350 000 000 0.800% Japan Government Twenty Year Bond 20/03/2042   | 2 539 413        | 0,10              |
| 210 000 000 0.400% Japan Government Twenty Year Bond 20/03/2036   | 1 529 171        | 0,06              | 350 000 000 0.900% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2042   | 2 582 042        | 0,10              |
| 190 000 000 0.200% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2036   | 1 343 776        | 0,05              | 335 000 000 1.100% Japan Government Twenty Year Bond 20/09/2042   | 2 556 511        | 0,10              |
| 269 050 000 0.500% Japan Government Twenty Year Bond 20/09/2036   | 1 974 806        | 0,07              | 100 000 000 1.400% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2042   | 799 917          | 0,03              |
| 75 000 000 0.600% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2036    | 556 890          | 0,02              | 51 950 000 0.005% Japan Government Two Year Bond 01/05/2024       | 390 893          | 0,01              |
| 205 000 000 0.700% Japan Government Twenty Year Bond 20/03/2037   | 1 537 816        | 0,06              | 200 000 000 0.005% Japan Government Two Year Bond 01/06/2024      | 1 505 147        | 0,06              |
| 248 000 000 0.600% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2037   | 1 833 512        | 0,07              | 100 000 000 0.005% Japan Government Two Year Bond 01/07/2024      | 752 528          | 0,03              |
| 205 000 000 0.600% Japan Government Twenty Year Bond 20/09/2037   | 1 510 398        | 0,06              | 200 000 000 0.005% Japan Government Two Year Bond 01/08/2024      | 1 505 102        | 0,06              |
| 240 800 000 0.600% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2037   | 1 768 086        | 0,07              | 200 000 000 0.005% Japan Government Two Year Bond 01/09/2024      | 1 505 087        | 0,06              |
| 179 000 000 0.500% Japan Government Twenty Year Bond 20/03/2038   | 1 292 232        | 0,05              | 250 000 000 0.005% Japan Government Two Year Bond 01/10/2024      | 1 881 603        | 0,07              |
| 238 700 000 0.500% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2038   | 1 718 213        | 0,06              | 400 000 000 0.005% Japan Government Two Year Bond 01/11/2024      | 3 010 444        | 0,11              |
| 181 350 000 0.700% Japan Government Twenty Year Bond 20/09/2038   | 1 340 183        | 0,05              | 350 000 000 0.005% Japan Government Two Year Bond 01/12/2024      | 2 634 717        | 0,10              |
| 235 000 000 0.500% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2038   | 1 683 422        | 0,06              | 400 000 000 0.005% Japan Government Two Year Bond 01/01/2025      | 3 010 865        | 0,11              |
| 215 000 000 0.400% Japan Government Twenty Year Bond 20/03/2039   | 1 509 749        | 0,06              | <b>316 359 838 11,88</b>  |                  |                   |
| 225 000 000 0.300% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2039   | 1 548 001        | 0,06              | <b>Ringgit malais – 0,32 %</b>                                    |                  |                   |
| 128 250 000 0.300% Japan Government Twenty Year Bond 20/09/2039   | 879 287          | 0,03              | 150 000 3.882% Malaysia Government Bond 14/03/2025                | 34 435           | 0,00              |
| 250 000 000 0.300% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2039   | 1 706 327        | 0,06              | 1 700 000 3.955% Malaysia Government Bond 15/09/2025              | 391 522          | 0,02              |
| 160 000 000 0.400% Japan Government Twenty Year Bond 20/03/2040   | 1 106 632        | 0,04              | 2 000 000 3.906% Malaysia Government Bond 15/07/2026              | 460 922          | 0,02              |
| 195 000 000 0.400% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2040   | 1 342 363        | 0,05              | 1 000 000 3.900% Malaysia Government Bond 30/11/2026              | 230 427          | 0,01              |
| 240 000 000 0.400% Japan Government Twenty Year Bond 20/09/2040   | 1 645 142        | 0,06              | 3 300 000 3.899% Malaysia Government Bond 16/11/2027              | 759 647          | 0,03              |
| 265 000 000 0.500% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2040   | 1 845 263        | 0,07              | 3 000 000 4.504% Malaysia Government Bond 30/04/2029              | 705 505          | 0,03              |
| 238 750 000 0.500% Japan Government Twenty Year Bond 20/03/2041   | 1 656 773        | 0,06              | 1 500 000 3.885% Malaysia Government Bond 15/08/2029              | 340 501          | 0,01              |
| 219 500 000 0.400% Japan Government Twenty Year Bond 20/06/2041   | 1 490 914        | 0,06              | 3 000 000 2.632% Malaysia Government Bond 15/04/2031              | 620 417          | 0,02              |
| 300 000 000 0.500% Japan Government Twenty Year Bond 20/09/2041   | 2 071 373        | 0,08              | 2 100 000 3.582% Malaysia Government Bond 15/07/2032              | 464 304          | 0,02              |
|   |                  |                   | 1 750 000 4.762% Malaysia Government Bond 07/04/2037              | 420 127          | 0,02              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>          |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>          |                  |                   |
| <b>Ringgit malais – 0,32 % (suite)</b>                            |                  |                   | <b>Dollar néo-zélandais – 0,14 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 250 000 4.893% Malaysia Government Bond 08/06/2038                | 61 322           | 0,00              | 600 000 4.500% New Zealand Government Bond 15/04/2027                      | 377 687          | 0,01              |
| 3 000 000 3.757% Malaysia Government Bond 22/05/2040              | 640 616          | 0,02              | 800 000 0.250% New Zealand Government Bond 15/05/2028                      | 409 180          | 0,02              |
| 3 700 000 4.696% Malaysia Government Bond 15/10/2042              | 894 809          | 0,03              | 650 000 3.000% New Zealand Government Bond 20/04/2029                      | 379 881          | 0,01              |
| 400 000 4.921% Malaysia Government Bond 06/07/2048                | 97 860           | 0,00              | 600 000 1.500% New Zealand Government Bond 15/05/2031                      | 305 657          | 0,01              |
| 1 000 000 4.065% Malaysia Government Bond 15/06/2050              | 213 863          | 0,01              | 750 000 2.000% New Zealand Government Bond 15/05/2032                      | 391 443          | 0,02              |
| 1 000 000 3.422% Malaysia Government Investment Issue 30/09/2027  | 225 194          | 0,01              | 400 000 3.500% New Zealand Government Bond 14/04/2033                      | 235 862          | 0,01              |
| 1 300 000 4.369% Malaysia Government Investment Issue 31/10/2028  | 304 838          | 0,01              | 250 000 4.250% New Zealand Government Bond 15/05/2034                      | 156 689          | 0,01              |
| 1 000 000 4.130% Malaysia Government Investment Issue 09/07/2029  | 229 963          | 0,01              | 500 000 2.750% New Zealand Government Bond 15/04/2037                      | 261 487          | 0,01              |
| 1 000 000 3.465% Malaysia Government Investment Issue 15/10/2030  | 220 179          | 0,01              | 300 000 1.750% New Zealand Government Bond 15/05/2041                      | 126 000          | 0,01              |
| 2 500 000 4.193% Malaysia Government Investment Issue 07/10/2032  | 577 399          | 0,02              | 100 000 2.750% New Zealand Government Bond 15/05/2051                      | 46 370           | 0,00              |
| 700 000 4.755% Malaysia Government Investment Issue 04/08/2037    | 168 119          | 0,01              | 100 000 2.250% New Zealand Local Government Funding Agency Bond 15/04/2024 | 60 614           | 0,00              |
| 1 500 000 4.467% Malaysia Government Investment Issue 15/09/2039  | 349 370          | 0,01              |  | <b>3 627 963</b> | <b>0,14</b>       |
|   | <b>8 411 339</b> | <b>0,32</b>       | <b>Couronne norvégienne – 0,07 %</b>                                       |                  |                   |
| <b>Peso mexicain – 0,27 %</b>                                     |                  |                   | 1 000 000 1.500% Norway Government Bond 19/02/2026                         | 91 605           | 0,00              |
| 8 750 000 8.000% Mexican Bonos 05/09/2024                         | 467 332          | 0,02              | 4 500 000 1.750% Norway Government Bond 17/02/2027                         | 410 878          | 0,02              |
| 1 750 000 10.000% Mexican Bonos 05/12/2024                        | 96 306           | 0,00              | 4 500 000 2.000% Norway Government Bond 26/04/2028                         | 410 685          | 0,02              |
| 22 500 000 5.750% Mexican Bonos 05/03/2026                        | 1 126 122        | 0,04              | 3 500 000 1.750% Norway Government Bond 06/09/2029                         | 311 020          | 0,01              |
| 10 000 000 5.500% Mexican Bonos 04/03/2027                        | 488 353          | 0,02              | 3 000 000 1.375% Norway Government Bond 19/08/2030                         | 256 549          | 0,01              |
| 8 000 000 7.500% Mexican Bonos 03/06/2027                         | 420 767          | 0,02              | 2 000 000 1.250% Norway Government Bond 17/09/2031                         | 166 801          | 0,01              |
| 14 000 000 8.500% Mexican Bonos 31/05/2029                        | 763 836          | 0,03              | 1 500 000 2.125% Norway Government Bond 18/05/2032                         | 133 642          | 0,00              |
| 25 500 000 7.750% Mexican Bonos 29/05/2031                        | 1 324 260        | 0,05              |  | <b>1 781 180</b> | <b>0,07</b>       |
| 5 000 000 7.500% Mexican Bonos 26/05/2033                         | 252 163          | 0,01              | <b>Nouveau sol péruvien – 0,04 %</b>                                       |                  |                   |
| 5 000 000 7.750% Mexican Bonos 23/11/2034                         | 255 599          | 0,01              | 1 750 000 5.940% Peru Government Bond 12/02/2029                           | 440 291          | 0,01              |
| 6 000 000 10.000% Mexican Bonos 20/11/2036                        | 364 034          | 0,01              | 1 000 000 6.150% Peru Government Bond 12/08/2032                           | 243 623          | 0,01              |
| 8 000 000 8.500% Mexican Bonos 18/11/2038                         | 424 094          | 0,02              | 1 000 000 5.400% Peru Government Bond 12/08/2034                           | 223 722          | 0,01              |
| 11 500 000 7.750% Mexican Bonos 13/11/2042                        | 557 612          | 0,02              | 1 000 000 5.350% Peru Government Bond 12/08/2040                           | 208 806          | 0,01              |
| 11 250 000 8.000% Mexican Bonos 07/11/2047                        | 557 466          | 0,02              |  | <b>1 116 442</b> | <b>0,04</b>       |
| 3 000 000 8.000% Mexican Bonos 31/07/2053                         | 147 966          | 0,00              |  |                  |                   |
|   | <b>7 245 910</b> | <b>0,27</b>       |  |                  |                   |
| <b>Dollar néo-zélandais – 0,14 %</b>                              |                  |                   |  |                  |                   |
| 500 000 0.500% New Zealand Government Bond 15/05/2024             | 297 922          | 0,01              |  |                  |                   |
| 500 000 2.750% New Zealand Government Bond 15/04/2025             | 301 548          | 0,01              |  |                  |                   |
| 500 000 0.500% New Zealand Government Bond 15/05/2026             | 277 623          | 0,01              |  |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>    |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>    |                  |                   |
| <b>Zloty polonais – 0,14 %</b>                                       |                  |                   |
| 800 000 2.250% Republic of Poland Government Bond 25/10/2024         | 175 398          | 0,01              |
| 1 000 000 0.750% Republic of Poland Government Bond 25/04/2025       | 208 997          | 0,01              |
| 600 000 3.250% Republic of Poland Government Bond 25/07/2025         | 131 192          | 0,00              |
| 1 700 000 2.500% Republic of Poland Government Bond 25/07/2026       | 354 281          | 0,01              |
| 2 500 000 3.750% Republic of Poland Government Bond 25/05/2027       | 534 238          | 0,02              |
| 1 450 000 2.500% Republic of Poland Government Bond 25/07/2027       | 293 224          | 0,01              |
| 700 000 2.750% Republic of Poland Government Bond 25/04/2028         | 140 163          | 0,01              |
| 2 950 000 2.750% Republic of Poland Government Bond 25/10/2029       | 568 300          | 0,02              |
| 4 000 000 1.250% Republic of Poland Government Bond 25/10/2030       | 667 987          | 0,03              |
| 4 000 000 1.750% Republic of Poland Government Bond 25/04/2032       | 658 525          | 0,02              |
|  | <b>3 732 305</b> | <b>0,14</b>       |
| <b>Livre sterling – 2,92 %</b>                                       |                  |                   |
| 200 000 1.250% Agence Francaise de Developpement EPIC 18/06/2025     | 231 313          | 0,01              |
| 200 000 4.375% Agence Francaise de Developpement EPIC 16/03/2026     | 246 600          | 0,01              |
| 100 000 0.375% BNG Bank NV 15/12/2025                                | 111 059          | 0,00              |
| 100 000 0.125% Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 15/12/2025 | 110 267          | 0,00              |
| 250 000 1.250% CPPIB Capital Inc 07/12/2027                          | 271 157          | 0,01              |
| 250 000 1.125% CPPIB Capital Inc 14/12/2029                          | 254 826          | 0,01              |
| 100 000 2.625% Export Development Canada 15/07/2027                  | 116 284          | 0,01              |
| 100 000 1.625% Isle of Man Government International Bond 14/09/2051  | 64 655           | 0,00              |
| 100 000 2.875% Jersey International Bond 06/05/2052                  | 88 299           | 0,00              |
| 100 000 0.250% Kommunalbanken AS 15/12/2025                          | 110 803          | 0,00              |
| 100 000 0.375% Kommunekredit 15/11/2024                              | 115 548          | 0,00              |
| 100 000 2.250% Province of Ontario Canada 26/05/2026                 | 115 800          | 0,01              |
| 100 000 0.750% Province of Quebec Canada 13/12/2024                  | 115 912          | 0,01              |
| 100 000 4.830% SNCF Reseau 25/03/2060                                | 127 704          | 0,01              |
| 724 000 1.000% United Kingdom Gilt 22/04/2024                        | 867 627          | 0,03              |
| 1 100 000 2.750% United Kingdom Gilt 07/09/2024                      | 1 337 790        | 0,05              |
| 2 700 000 0.250% United Kingdom Gilt 31/01/2025                      | 3 123 188        | 0,12              |
| 400 000 5.000% United Kingdom Gilt 07/03/2025                        | 505 847          | 0,02              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Livre sterling – 2,92 % (suite)</b>                            |                  |                   |
| 1 650 000 0.625% United Kingdom Gilt 07/06/2025                   | 1 919 897        | 0,07              |
| 1 550 000 2.000% United Kingdom Gilt 07/09/2025                   | 1 845 338        | 0,07              |
| 300 000 3.500% United Kingdom Gilt 22/10/2025                     | 367 393          | 0,01              |
| 1 600 000 0.125% United Kingdom Gilt 30/01/2026                   | 1 802 072        | 0,07              |
| 2 137 000 1.500% United Kingdom Gilt 22/07/2026                   | 2 480 374        | 0,09              |
| 2 000 000 0.375% United Kingdom Gilt 22/10/2026                   | 2 208 399        | 0,08              |
| 1 100 000 4.125% United Kingdom Gilt 29/01/2027                   | 1 377 790        | 0,05              |
| 2 150 000 1.250% United Kingdom Gilt 22/07/2027                   | 2 429 482        | 0,09              |
| 1 539 000 4.250% United Kingdom Gilt 07/12/2027                   | 1 971 097        | 0,07              |
| 1 809 000 0.125% United Kingdom Gilt 31/01/2028                   | 1 910 465        | 0,07              |
| 1 615 000 1.625% United Kingdom Gilt 22/10/2028                   | 1 821 203        | 0,07              |
| 100 000 6.000% United Kingdom Gilt 07/12/2028                     | 139 892          | 0,01              |
| 1 500 000 0.500% United Kingdom Gilt 31/01/2029                   | 1 559 633        | 0,06              |
| 2 070 000 0.875% United Kingdom Gilt 22/10/2029                   | 2 184 518        | 0,08              |
| 1 719 000 0.375% United Kingdom Gilt 22/10/2030                   | 1 700 217        | 0,06              |
| 1 797 000 4.750% United Kingdom Gilt 07/12/2030                   | 2 427 182        | 0,09              |
| 1 863 000 0.250% United Kingdom Gilt 31/07/2031                   | 1 776 533        | 0,07              |
| 1 935 000 1.000% United Kingdom Gilt 31/01/2032                   | 1 947 448        | 0,07              |
| 654 100 4.250% United Kingdom Gilt 07/06/2032                     | 862 448          | 0,03              |
| 200 000 3.250% United Kingdom Gilt 31/01/2033                     | 241 840          | 0,01              |
| 1 004 000 0.875% United Kingdom Gilt 31/07/2033                   | 957 029          | 0,04              |
| 2 041 000 4.500% United Kingdom Gilt 07/09/2034                   | 2 743 046        | 0,10              |
| 1 712 000 0.625% United Kingdom Gilt 31/07/2035                   | 1 483 773        | 0,06              |
| 1 185 000 4.250% United Kingdom Gilt 07/03/2036                   | 1 554 160        | 0,06              |
| 1 325 000 1.750% United Kingdom Gilt 07/09/2037                   | 1 272 219        | 0,05              |
| 700 000 3.750% United Kingdom Gilt 29/01/2038                     | 859 751          | 0,03              |
| 1 004 000 4.750% United Kingdom Gilt 07/12/2038                   | 1 382 145        | 0,05              |
| 950 000 1.125% United Kingdom Gilt 31/01/2039                     | 800 180          | 0,03              |
| 930 000 4.250% United Kingdom Gilt 07/09/2039                     | 1 208 279        | 0,05              |
| 1 300 000 4.250% United Kingdom Gilt 07/12/2040                   | 1 692 657        | 0,06              |
| 1 974 000 1.250% United Kingdom Gilt 22/10/2041                   | 1 609 017        | 0,06              |
| 1 090 000 4.500% United Kingdom Gilt 07/12/2042                   | 1 468 743        | 0,06              |
| 1 375 000 3.250% United Kingdom Gilt 22/01/2044                   | 1 546 785        | 0,06              |
| 1 300 000 3.500% United Kingdom Gilt 22/01/2045                   | 1 515 169        | 0,06              |
| 1 200 000 0.875% United Kingdom Gilt 31/01/2046                   | 813 015          | 0,03              |
| 525 000 4.250% United Kingdom Gilt 07/12/2046                     | 684 566          | 0,03              |
| 1 105 000 1.500% United Kingdom Gilt 22/07/2047                   | 857 708          | 0,03              |
| 1 156 000 1.750% United Kingdom Gilt 22/01/2049                   | 939 074          | 0,04              |
| 885 000 4.250% United Kingdom Gilt 07/12/2049                     | 1 161 511        | 0,04              |
| 1 400 000 0.625% United Kingdom Gilt 22/10/2050                   | 793 487          | 0,03              |
| 1 250 000 1.250% United Kingdom Gilt 31/07/2051                   | 859 951          | 0,03              |
| 1 000 000 3.750% United Kingdom Gilt 22/07/2052                   | 1 214 478        | 0,05              |
| 505 000 1.500% United Kingdom Gilt 31/07/2053                     | 364 841          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                   |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                   |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Livre sterling – 2,92 % (suite)</b>                            |                   |                   | <b>Dollar de Singapour – 0,18 % (suite)</b>                       |                  |                   |
| 200 000 3.750% United Kingdom Gilt 22/10/2053                     | 242 203           | 0,01              | 200 000 3.375% Singapore Government Bond 01/09/2033               | 156 131          | 0,01              |
| 1 217 000 1.625% United Kingdom Gilt 22/10/2054                   | 905 700           | 0,03              | 400 000 2.250% Singapore Government Bond 01/08/2036               | 279 598          | 0,01              |
| 1 037 000 4.250% United Kingdom Gilt 07/12/2055                   | 1 384 313         | 0,05              | 450 000 2.375% Singapore Government Bond 01/07/2039               | 317 950          | 0,01              |
| 1 534 000 1.750% United Kingdom Gilt 22/07/2057                   | 1 174 521         | 0,04              | 100 000 2.750% Singapore Government Bond 01/04/2042               | 75 345           | 0,00              |
| 925 000 4.000% United Kingdom Gilt 22/01/2060                     | 1 207 593         | 0,05              | 260 000 2.750% Singapore Government Bond 01/03/2046               | 197 573          | 0,01              |
| 1 221 000 0.500% United Kingdom Gilt 22/10/2061                   | 541 184           | 0,02              | 450 000 1.875% Singapore Government Bond 01/03/2050               | 293 212          | 0,01              |
| 825 000 2.500% United Kingdom Gilt 22/07/2065                     | 766 675           | 0,03              | 350 000 1.875% Singapore Government Bond 01/10/2051               | 229 722          | 0,01              |
| 1 596 000 3.500% United Kingdom Gilt 22/07/2068**                 | 1 905 924         | 0,07              |   | <b>4 873 149</b> | <b>0,18</b>       |
| 1 100 000 1.625% United Kingdom Gilt 22/10/2071                   | 761 245           | 0,03              |   |                  |                   |
| 473 000 1.125% United Kingdom Gilt 22/10/2073                     | 261 096           | 0,01              |   |                  |                   |
|   | <b>77 819 938</b> | <b>2,92</b>       |   |                  |                   |
| <b>Leu roumain – 0,05 %</b>                                       |                   |                   | <b>Won sud-coréen – 1,01 %</b>                                    |                  |                   |
| 500 000 3.650% Romania Government Bond 28/07/2025                 | 101 956           | 0,00              | 3 500 000 000 1.125% Korea Treasury Bond 10/06/2024               | 2 620 356        | 0,10              |
| 1 250 000 4.850% Romania Government Bond 22/04/2026               | 257 469           | 0,01              | 800 000 000 1.375% Korea Treasury Bond 10/09/2024                 | 597 881          | 0,02              |
| 1 000 000 2.500% Romania Government Bond 25/10/2027               | 180 201           | 0,01              | 1 600 000 000 1.500% Korea Treasury Bond 10/03/2025               | 1 186 779        | 0,04              |
| 1 000 000 4.150% Romania Government Bond 26/01/2028               | 192 483           | 0,01              | 750 000 000 3.125% Korea Treasury Bond 10/06/2025                 | 573 764          | 0,02              |
| 1 000 000 5.000% Romania Government Bond 12/02/2029               | 195 911           | 0,01              | 2 100 000 000 1.125% Korea Treasury Bond 10/09/2025               | 1 530 612        | 0,06              |
| 1 000 000 4.150% Romania Government Bond 24/10/2030               | 179 643           | 0,00              | 2 500 000 000 1.250% Korea Treasury Bond 10/03/2026               | 1 809 425        | 0,07              |
| 1 000 000 6.700% Romania Government Bond 25/02/2032               | 209 568           | 0,01              | 500 000 000 1.750% Korea Treasury Bond 10/09/2026                 | 364 289          | 0,01              |
|   | <b>1 317 231</b>  | <b>0,05</b>       | 275 000 000 1.500% Korea Treasury Bond 10/12/2026                 | 197 831          | 0,01              |
| <b>Dollar de Singapour – 0,18 %</b>                               |                   |                   | 400 000 000 2.125% Korea Treasury Bond 10/06/2027                 | 292 353          | 0,01              |
| 200 000 2.375% Singapore Government Bond 01/06/2025               | 148 118           | 0,00              | 200 000 000 2.375% Korea Treasury Bond 10/12/2027                 | 147 085          | 0,01              |
| 750 000 0.500% Singapore Government Bond 01/11/2025               | 528 494           | 0,02              | 1 000 000 000 2.625% Korea Treasury Bond 10/06/2028               | 740 416          | 0,03              |
| 200 000 2.125% Singapore Government Bond 01/06/2026               | 146 365           | 0,00              | 400 000 000 2.375% Korea Treasury Bond 10/12/2028                 | 291 087          | 0,01              |
| 400 000 1.250% Singapore Government Bond 01/11/2026               | 282 998           | 0,01              | 1 200 000 000 1.875% Korea Treasury Bond 10/06/2029               | 844 927          | 0,03              |
| 35 000 3.500% Singapore Government Bond 01/03/2027                | 26 790            | 0,00              | 2 650 000 000 1.375% Korea Treasury Bond 10/12/2029               | 1 791 440        | 0,07              |
| 600 000 2.875% Singapore Government Bond 01/09/2027               | 450 130           | 0,02              | 800 000 000 1.375% Korea Treasury Bond 10/06/2030                 | 535 951          | 0,02              |
| 750 000 2.625% Singapore Government Bond 01/05/2028               | 555 910           | 0,02              | 1 700 000 000 1.500% Korea Treasury Bond 10/12/2030               | 1 142 069        | 0,04              |
| 700 000 2.875% Singapore Government Bond 01/07/2029               | 523 946           | 0,02              | 2 550 000 000 2.000% Korea Treasury Bond 10/06/2031               | 1 766 186        | 0,07              |
| 650 000 1.625% Singapore Government Bond 01/07/2031               | 441 206           | 0,02              |   |                  |                   |
| 300 000 2.625% Singapore Government Bond 01/08/2032               | 219 661           | 0,01              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation | Investissement  | Juste valeur<br>USD | % des<br>actifs<br>nets | Partici-<br>pation | Investissement  | Juste<br>valeur<br>USD | % des<br>actifs<br>nets |
|---------------|---|---------------------|-------------------------|--------------------|---|------------------------|-------------------------|
|               | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %)<br/>(suite)</b> |                     |                         |                    | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %)<br/>(suite)</b> |                        |                         |
|               | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>     |                     |                         |                    | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>     |                        |                         |
|               | <b>Won sud-coréen – 1,01 % (suite)</b>                                |                     |                         |                    | <b>Franc suisse – 0,28 %</b>  |                        |                         |
| 500 000 000   | 2.375% Korea Treasury Bond<br>10/12/2031                              | 355 479             | 0,01                    | 100 000            | 1.625% Canton of Geneva Switzerland<br>30/07/2029                     | 107 863                | 0,00                    |
| 1 650 000 000 | 3.375% Korea Treasury Bond<br>10/06/2032                              | 1 266 743           | 0,05                    | 950 000            | 1.250% Swiss Confederation<br>Government Bond 28/05/2026              | 1 040 149              | 0,04                    |
| 615 000 000   | 2.250% Korea Treasury Bond<br>10/09/2037                              | 413 449             | 0,02                    | 500 000            | 3.250% Swiss Confederation<br>Government Bond 27/05/2027              | 591 916                | 0,02                    |
| 925 000 000   | 2.375% Korea Treasury Bond<br>10/09/2038                              | 624 397             | 0,02                    | 1 050 000          | 0.000% Swiss Confederation<br>Government Bond 22/06/2029              | 1 068 355              | 0,04                    |
| 900 000 000   | 1.125% Korea Treasury Bond<br>10/09/2039                              | 499 903             | 0,02                    | 700 000            | 0.500% Swiss Confederation<br>Government Bond 27/05/2030              | 731 401                | 0,03                    |
| 1 000 000 000 | 1.500% Korea Treasury Bond<br>10/09/2040                              | 579 014             | 0,02                    | 450 000            | 2.250% Swiss Confederation<br>Government Bond 22/06/2031              | 533 518                | 0,02                    |
| 950 000 000   | 1.875% Korea Treasury Bond<br>10/09/2041                              | 581 085             | 0,02                    | 150 000            | 0.000% Swiss Confederation<br>Government Bond 26/06/2034              | 144 069                | 0,01                    |
| 900 000 000   | 3.250% Korea Treasury Bond<br>10/09/2042                              | 679 461             | 0,03                    | 600 000            | 0.250% Swiss Confederation<br>Government Bond 23/06/2035              | 587 699                | 0,02                    |
| 412 500 000   | 2.125% Korea Treasury Bond<br>10/03/2047                              | 251 733             | 0,01                    | 100 000            | 2.500% Swiss Confederation<br>Government Bond 08/03/2036              | 125 189                | 0,00                    |
| 1 200 000 000 | 2.625% Korea Treasury Bond<br>10/03/2048                              | 811 522             | 0,03                    | 175 000            | 1.250% Swiss Confederation<br>Government Bond 27/06/2037              | 190 516                | 0,01                    |
| 1 150 000 000 | 2.000% Korea Treasury Bond<br>10/03/2049                              | 673 817             | 0,03                    | 450 000            | 1.500% Swiss Confederation<br>Government Bond 26/10/2038              | 513 775                | 0,02                    |
| 1 750 000 000 | 1.500% Korea Treasury Bond<br>10/03/2050                              | 903 101             | 0,03                    | 500 000            | 0.000% Swiss Confederation<br>Government Bond 24/07/2039              | 446 243                | 0,02                    |
| 2 650 000 000 | 1.875% Korea Treasury Bond<br>10/03/2051                              | 1 490 318           | 0,06                    | 450 000            | 1.500% Swiss Confederation<br>Government Bond 30/04/2042              | 511 302                | 0,02                    |
| 1 000 000 000 | 2.500% Korea Treasury Bond<br>10/03/2052                              | 643 300             | 0,02                    | 300 000            | 0.500% Swiss Confederation<br>Government Bond 28/06/2045              | 280 904                | 0,01                    |
| 800 000 000   | 3.125% Korea Treasury Bond<br>10/09/2052                              | 587 291             | 0,02                    | 275 000            | 0.500% Swiss Confederation<br>Government Bond 24/05/2055              | 243 871                | 0,01                    |
|               |   | <b>26 793 064</b>   | <b>1,01</b>             | 100 000            | 0.500% Swiss Confederation<br>Government Bond 30/05/2058              | 87 489                 | 0,00                    |
|               | <b>Couronne suédoise – 0,26 %</b>                                     |                     |                         | 150 000            | 2.000% Swiss Confederation<br>Government Bond 25/06/2064              | 212 691                | 0,01                    |
| 14 500 000    | 2.500% Sweden Government Bond<br>12/05/2025                           | 1 387 865           | 0,05                    |                    |   | <b>7 416 950</b>       | <b>0,28</b>             |
| 17 000 000    | 1.000% Sweden Government Bond<br>12/11/2026                           | 1 553 117           | 0,06                    |                    | <b>Baht thaïlandais – 0,29 %</b>                                      |                        |                         |
| 11 200 000    | 0.750% Sweden Government Bond<br>12/05/2028                           | 996 865             | 0,04                    | 3 000 000          | 0.750% Thailand Government Bond<br>17/06/2024                         | 86 711                 | 0,00                    |
| 12 000 000    | 0.750% Sweden Government Bond<br>12/11/2029                           | 1 049 415           | 0,04                    | 21 400 000         | 1.450% Thailand Government Bond<br>17/12/2024                         | 622 174                | 0,02                    |
| 9 000 000     | 0.125% Sweden Government Bond<br>12/05/2031                           | 733 345             | 0,03                    | 6 000 000          | 3.850% Thailand Government Bond<br>12/12/2025                         | 184 815                | 0,01                    |
| 3 000 000     | 2.250% Sweden Government Bond<br>01/06/2032                           | 289 861             | 0,01                    | 14 500 000         | 2.125% Thailand Government Bond<br>17/12/2026                         | 427 291                | 0,02                    |
| 1 000 000     | 3.500% Sweden Government Bond<br>30/03/2039                           | 112 028             | 0,00                    | 14 650 000         | 1.000% Thailand Government Bond<br>17/06/2027                         | 412 029                | 0,02                    |
| 10 500 000    | 0.125% Sweden Government<br>International Bond 09/09/2030             | 871 902             | 0,03                    | 17 250 000         | 2.650% Thailand Government Bond<br>17/06/2028                         | 519 538                | 0,02                    |
|               |   | <b>6 994 398</b>    | <b>0,26</b>             | 19 250 000         | 2.875% Thailand Government Bond<br>17/12/2028                         | 587 549                | 0,02                    |



## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>      |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>      |                  |                   |
| <b>Baht thaïlandais – 0,29 % (suite)</b>                          |                  |                   | <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                              |                  |                   |
| 20 500 000 2.000% Thailand Government Bond 17/12/2031             | 584 995          | 0,02              | 200 000 4.750% BNG Bank NV 22/05/2024                                  | 200 270          | 0,01              |
| 16 000 000 3.775% Thailand Government Bond 25/06/2032             | 523 716          | 0,02              | 200 000 0.875% BNG Bank NV 18/05/2026                                  | 181 540          | 0,01              |
| 40 000 000 1.585% Thailand Government Bond 17/12/2035             | 1 045 533        | 0,04              | 200 000 4.625% Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 02/11/2025   | 202 600          | 0,01              |
| 2 500 000 3.400% Thailand Government Bond 17/06/2036              | 79 097           | 0,00              | 1 000 000 4.000% Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 25/01/2026 | 999 290          | 0,04              |
| 48 000 000 3.300% Thailand Government Bond 17/06/2038             | 1 496 851        | 0,06              | 300 000 1.375% Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 20/01/2031   | 250 341          | 0,01              |
| 9 000 000 4.675% Thailand Government Bond 29/06/2044              | 337 094          | 0,01              | 300 000 2.125% Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 26/01/2032   | 261 912          | 0,01              |
| 8 500 000 2.875% Thailand Government Bond 17/06/2046              | 243 282          | 0,01              | 200 000 7.500% California State 01/04/2034                             | 250 438          | 0,01              |
| 5 000 000 1.875% Thailand Government Bond 17/06/2049              | 115 611          | 0,00              | 100 000 7.550% California State 01/04/2039                             | 129 328          | 0,00              |
| 5 000 000 4.000% Thailand Government Bond 17/06/2066              | 161 690          | 0,01              | 150 000 7.300% California State 01/10/2039                             | 186 686          | 0,01              |
| 9 000 000 3.600% Thailand Government Bond 17/06/2067              | 268 073          | 0,01              | 100 000 7.625% California State 01/03/2040                             | 129 728          | 0,00              |
|   | <b>7 696 049</b> | <b>0,29</b>       | 50 000 7.600% California State 01/11/2040                              | 64 948           | 0,00              |
|   |                  |                   | 250 000 1.625% Canada Government International Bond 22/01/2025         | 239 275          | 0,01              |
|   |                  |                   | 200 000 2.875% Canada Government International Bond 28/04/2025         | 195 278          | 0,01              |
|   |                  |                   | 100 000 0.750% Canada Government International Bond 19/05/2026         | 90 983           | 0,00              |
|   |                  |                   | 500 000 3.631% CD 2017-CD3 Mortgage Trust 10/02/2050                   | 467 440          | 0,02              |
|   |                  |                   | 250 000 1.000% CDP Financial Inc 26/05/2026                            | 226 865          | 0,01              |
|   |                  |                   | 100 000 3.587% Chicago Sales Tax Securitization Corp 01/01/2043        | 85 448           | 0,00              |
|   |                  |                   | 200 000 3.240% Chile Government International Bond 06/02/2028          | 191 424          | 0,01              |
|   |                  |                   | 200 000 3.500% Chile Government International Bond 31/01/2034          | 178 250          | 0,01              |
|   |                  |                   | 200 000 3.100% Chile Government International Bond 07/05/2041          | 150 728          | 0,01              |
|   |                  |                   | 200 000 4.340% Chile Government International Bond 07/03/2042          | 176 986          | 0,01              |
|   |                  |                   | 200 000 3.860% Chile Government International Bond 21/06/2047          | 164 294          | 0,01              |
|   |                  |                   | 100 000 3.500% Chile Government International Bond 25/01/2050          | 75 142           | 0,00              |
|   |                  |                   | 200 000 3.100% Chile Government International Bond 22/01/2061          | 131 134          | 0,01              |
|   |                  |                   | 200 000 3.375% China Development Bank 24/01/2027                       | 195 358          | 0,01              |
|   |                  |                   | 200 000 0.625% China Development Bank/Hong Kong 09/09/2024             | 189 256          | 0,01              |
|   |                  |                   | 200 000 2.000% China Development Bank/Hong Kong 16/02/2027             | 186 064          | 0,01              |
|   |                  |                   | 200 000 1.250% China Government International Bond 26/10/2026          | 182 340          | 0,01              |
|   |                  |                   | 400 000 2.750% China Government International Bond 03/12/2039          | 330 468          | 0,01              |
|   |                  |                   |  |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>           |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>           |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                                   |                  |                   | <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 200 000 4.000% China Government International Bond 19/10/2048               | 193 572          | 0,01              | 24 453 3.500% Fannie Mae Pool 01/07/2032                          | 23 862           | 0,00              |
| 300 000 3.778% Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC33 10/09/2058     | 287 692          | 0,01              | 49 078 2.500% Fannie Mae Pool 01/12/2032                          | 45 785           | 0,00              |
| 200 000 6.574% City of Los Angeles Department of Water and Power 01/07/2045 | 238 982          | 0,01              | 25 579 2.500% Fannie Mae Pool 01/01/2033                          | 23 863           | 0,00              |
| 200 000 5.850% Connecticut State 15/03/2032                                 | 217 021          | 0,01              | 33 483 3.000% Fannie Mae Pool 01/01/2033                          | 32 067           | 0,00              |
| 250 000 0.875% CPPIB Capital Inc 09/09/2026                                 | 224 860          | 0,01              | 36 989 3.000% Fannie Mae Pool 01/02/2033                          | 35 424           | 0,00              |
| 250 000 2.000% CPPIB Capital Inc 01/11/2029                                 | 221 468          | 0,01              | 58 906 3.500% Fannie Mae Pool 01/02/2033                          | 57 482           | 0,00              |
| 200 000 1.750% Development Bank of Japan Inc 18/02/2025                     | 190 248          | 0,01              | 44 886 4.000% Fannie Mae Pool 01/04/2033                          | 44 412           | 0,00              |
| 200 000 1.000% Development Bank of Japan Inc 27/08/2030                     | 160 844          | 0,01              | 29 148 3.000% Fannie Mae Pool 01/10/2033                          | 27 869           | 0,00              |
| 200 000 1.750% Development Bank of Japan Inc 20/10/2031                     | 167 250          | 0,01              | 144 011 2.500% Fannie Mae Pool 01/12/2033                         | 136 175          | 0,01              |
| 200 000 3.000% Export Development Canada 25/05/2027                         | 194 056          | 0,01              | 1 310 625 3.000% Fannie Mae Pool 01/02/2034                       | 1 255 185        | 0,05              |
| 200 000 4.625% Export Finance & Insurance Corp 26/10/2027                   | 205 212          | 0,01              | 53 872 3.500% Fannie Mae Pool 01/11/2034                          | 52 356           | 0,00              |
| 200 000 3.250% Export-Import Bank of China 28/11/2027                       | 192 992          | 0,01              | 133 781 2.500% Fannie Mae Pool 01/12/2034                         | 124 715          | 0,00              |
| 200 000 4.000% Export-Import Bank of China 28/11/2047                       | 182 306          | 0,01              | 62 221 3.000% Fannie Mae Pool 01/01/2035                          | 59 236           | 0,00              |
| 200 000 2.250% Export-Import Bank of India 13/01/2031                       | 161 426          | 0,01              | 252 412 2.500% Fannie Mae Pool 01/02/2035                         | 237 741          | 0,01              |
| 200 000 2.375% Export-Import Bank of Korea 25/06/2024                       | 194 688          | 0,01              | 217 450 3.500% Fannie Mae Pool 01/05/2035                         | 212 192          | 0,01              |
| 200 000 4.250% Export-Import Bank of Korea 15/09/2027                       | 198 000          | 0,01              | 178 726 2.000% Fannie Mae Pool 01/08/2035                         | 161 934          | 0,01              |
| 200 000 1.750% Export-Import Bank of Korea 19/10/2028                       | 173 852          | 0,01              | 987 129 2.500% Fannie Mae Pool 01/08/2035                         | 919 227          | 0,03              |
| 250 000 2.125% Export-Import Bank of Korea 18/01/2032                       | 208 035          | 0,01              | 787 508 2.000% Fannie Mae Pool 01/09/2035                         | 713 521          | 0,03              |
| 200 000 1.831% Export-Import Bank of Malaysia Bhd 26/11/2026                | 180 688          | 0,01              | 841 933 2.500% Fannie Mae Pool 01/09/2035                         | 784 019          | 0,03              |
| 78 679 3.000% Fannie Mae Pool 01/12/2026                                    | 76 247           | 0,00              | 313 613 2.000% Fannie Mae Pool 01/10/2035                         | 284 148          | 0,01              |
| 23 388 2.500% Fannie Mae Pool 01/12/2027                                    | 22 385           | 0,00              | 363 685 1.500% Fannie Mae Pool 01/12/2035                         | 321 185          | 0,01              |
| 23 947 2.500% Fannie Mae Pool 01/04/2028                                    | 22 880           | 0,00              | 734 757 2.000% Fannie Mae Pool 01/12/2035                         | 665 725          | 0,03              |
| 122 211 2.500% Fannie Mae Pool 01/06/2029                                   | 116 999          | 0,00              | 737 338 2.500% Fannie Mae Pool 01/12/2035                         | 686 619          | 0,03              |
| 131 588 2.500% Fannie Mae Pool 01/07/2030                                   | 126 723          | 0,00              | 621 803 2.000% Fannie Mae Pool 01/01/2036                         | 563 384          | 0,02              |
| 242 890 3.000% Fannie Mae Pool 01/09/2030                                   | 234 603          | 0,01              | 708 941 2.000% Fannie Mae Pool 01/02/2036                         | 642 335          | 0,02              |
| 44 599 4.000% Fannie Mae Pool 01/03/2031                                    | 43 817           | 0,00              | 394 380 1.500% Fannie Mae Pool 01/04/2036                         | 347 545          | 0,01              |
| 97 752 2.500% Fannie Mae Pool 01/08/2031                                    | 92 070           | 0,00              | 302 527 2.000% Fannie Mae Pool 01/04/2036                         | 273 698          | 0,01              |
| 70 812 3.000% Fannie Mae Pool 01/09/2031                                    | 68 358           | 0,00              | 318 371 1.500% Fannie Mae Pool 01/05/2036                         | 280 563          | 0,01              |
| 60 508 2.500% Fannie Mae Pool 01/04/2032                                    | 56 992           | 0,00              | 90 609 2.500% Fannie Mae Pool 01/05/2036                          | 84 120           | 0,00              |
| 167 548 3.000% Fannie Mae Pool 01/04/2032                                   | 161 773          | 0,00              | 1 711 628 2.000% Fannie Mae Pool 01/06/2036                       | 1 548 519        | 0,05              |
| 56 198 3.000% Fannie Mae Pool 01/05/2032                                    | 53 820           | 0,00              | 617 329 1.500% Fannie Mae Pool 01/07/2036                         | 544 017          | 0,02              |
| 293 069 2.500% Fannie Mae Pool 01/06/2032                                   | 276 035          | 0,01              | 251 188 3.000% Fannie Mae Pool 01/09/2036                         | 236 239          | 0,01              |
|   |                  |                   | 2 214 547 2.000% Fannie Mae Pool 01/11/2036                       | 2 003 447        | 0,07              |
|   |                  |                   | 869 116 2.000% Fannie Mae Pool 01/12/2036                         | 786 295          | 0,03              |
|   |                  |                   | 1 590 587 1.500% Fannie Mae Pool 01/03/2037                       | 1 398 637        | 0,05              |
|   |                  |                   | 231 306 3.000% Fannie Mae Pool 01/04/2037                         | 217 541          | 0,01              |
|   |                  |                   | 325 001 3.500% Fannie Mae Pool 01/05/2037                         | 316 793          | 0,01              |
|   |                  |                   | 854 969 3.000% Fannie Mae Pool 01/02/2038                         | 810 234          | 0,03              |
|   |                  |                   | 14 731 3.500% Fannie Mae Pool 01/04/2038                          | 14 021           | 0,00              |
|   |                  |                   | 109 682 3.500% Fannie Mae Pool 01/04/2039                         | 105 511          | 0,00              |
|   |                  |                   | 309 529 4.500% Fannie Mae Pool 01/09/2039                         | 310 640          | 0,01              |
|   |                  |                   | 924 853 2.500% Fannie Mae Pool 01/08/2040                         | 817 957          | 0,03              |
|   |                  |                   | 190 329 4.000% Fannie Mae Pool 01/08/2040                         | 186 331          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Partici-<br>pation Investissement                                 | Juste<br>valeur<br>USD | % des<br>actifs<br>nets | Partici-<br>pation Investissement                                 | Juste<br>valeur<br>USD | % des<br>actifs<br>nets |
|---|------------------------|-------------------------|---|------------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                        |                         | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                        |                         |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                        |                         | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                        |                         |
| <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                        |                         | <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                        |                         |
| 44 608 2.000% Fannie Mae Pool 01/09/2040                          | 38 135                 | 0,00                    | 60 588 3.000% Fannie Mae Pool 01/01/2047                          | 55 454                 | 0,00                    |
| 410 718 3.000% Fannie Mae Pool 01/10/2040                         | 388 040                | 0,01                    | 77 838 3.500% Fannie Mae Pool 01/01/2047                          | 73 355                 | 0,00                    |
| 179 459 2.000% Fannie Mae Pool 01/01/2041                         | 153 289                | 0,01                    | 57 183 3.500% Fannie Mae Pool 01/02/2047                          | 54 063                 | 0,00                    |
| 150 247 3.500% Fannie Mae Pool 01/03/2041                         | 142 439                | 0,01                    | 273 068 4.000% Fannie Mae Pool 01/02/2047                         | 266 288                | 0,01                    |
| 452 553 1.500% Fannie Mae Pool 01/11/2041                         | 372 222                | 0,01                    | 1 078 124 3.000% Fannie Mae Pool 01/03/2047                       | 992 771                | 0,03                    |
| 87 713 2.500% Fannie Mae Pool 01/11/2041                          | 77 556                 | 0,00                    | 16 919 4.000% Fannie Mae Pool 01/03/2047                          | 16 437                 | 0,00                    |
| 158 717 2.500% Fannie Mae Pool 01/12/2041                         | 140 338                | 0,01                    | 171 906 3.000% Fannie Mae Pool 01/04/2047                         | 157 339                | 0,01                    |
| 430 477 4.500% Fannie Mae Pool 01/01/2042                         | 432 191                | 0,02                    | 146 209 4.000% Fannie Mae Pool 01/04/2047                         | 142 046                | 0,00                    |
| 108 649 3.000% Fannie Mae Pool 01/09/2042                         | 100 161                | 0,00                    | 723 327 3.500% Fannie Mae Pool 01/05/2047                         | 683 473                | 0,02                    |
| 81 376 3.000% Fannie Mae Pool 01/10/2042                          | 75 019                 | 0,00                    | 136 935 4.500% Fannie Mae Pool 01/05/2047                         | 137 375                | 0,00                    |
| 721 772 4.000% Fannie Mae Pool 01/10/2042                         | 698 828                | 0,03                    | 49 749 3.500% Fannie Mae Pool 01/06/2047                          | 47 137                 | 0,00                    |
| 722 542 4.000% Fannie Mae Pool 01/12/2042                         | 707 369                | 0,03                    | 266 676 3.000% Fannie Mae Pool 01/07/2047                         | 244 079                | 0,01                    |
| 519 532 3.000% Fannie Mae Pool 01/01/2043                         | 478 947                | 0,02                    | 1 424 346 3.500% Fannie Mae Pool 01/07/2047                       | 1 353 701              | 0,05                    |
| 122 128 3.500% Fannie Mae Pool 01/07/2043                         | 116 119                | 0,00                    | 181 631 3.000% Fannie Mae Pool 01/10/2047                         | 166 240                | 0,01                    |
| 281 321 4.000% Fannie Mae Pool 01/09/2043                         | 275 329                | 0,01                    | 219 942 4.000% Fannie Mae Pool 01/10/2047                         | 213 680                | 0,01                    |
| 606 626 3.000% Fannie Mae Pool 01/10/2043                         | 558 959                | 0,02                    | 74 052 2.500% Fannie Mae Pool 01/11/2047                          | 65 188                 | 0,00                    |
| 98 699 4.000% Fannie Mae Pool 01/11/2043                          | 96 597                 | 0,00                    | 76 903 3.500% Fannie Mae Pool 01/11/2047                          | 72 415                 | 0,00                    |
| 84 876 4.000% Fannie Mae Pool 01/05/2044                          | 83 094                 | 0,00                    | 117 972 3.000% Fannie Mae Pool 01/12/2047                         | 107 975                | 0,00                    |
| 85 283 5.500% Fannie Mae Pool 01/05/2044                          | 88 876                 | 0,00                    | 35 142 3.500% Fannie Mae Pool 01/12/2047                          | 33 091                 | 0,00                    |
| 108 785 4.000% Fannie Mae Pool 01/08/2044                         | 106 473                | 0,00                    | 53 373 4.000% Fannie Mae Pool 01/12/2047                          | 51 853                 | 0,00                    |
| 281 381 3.500% Fannie Mae Pool 01/02/2045                         | 267 425                | 0,00                    | 427 384 3.500% Fannie Mae Pool 01/01/2048                         | 402 683                | 0,01                    |
| 110 405 3.000% Fannie Mae Pool 01/05/2045                         | 101 729                | 0,00                    | 38 296 4.000% Fannie Mae Pool 01/01/2048                          | 37 205                 | 0,00                    |
| 60 342 3.500% Fannie Mae Pool 01/05/2045                          | 57 349                 | 0,00                    | 34 874 4.500% Fannie Mae Pool 01/01/2048                          | 34 790                 | 0,00                    |
| 62 432 4.000% Fannie Mae Pool 01/06/2045                          | 61 114                 | 0,00                    | 126 395 3.000% Fannie Mae Pool 01/02/2048                         | 115 685                | 0,00                    |
| 95 601 3.000% Fannie Mae Pool 01/08/2045                          | 88 089                 | 0,00                    | 514 496 3.500% Fannie Mae Pool 01/02/2048                         | 484 471                | 0,02                    |
| 502 956 3.500% Fannie Mae Pool 01/08/2045                         | 475 510                | 0,02                    | 421 076 4.500% Fannie Mae Pool 01/02/2048                         | 422 003                | 0,02                    |
| 55 190 4.000% Fannie Mae Pool 01/08/2045                          | 54 015                 | 0,00                    | 26 790 3.500% Fannie Mae Pool 01/03/2048                          | 25 219                 | 0,00                    |
| 65 765 3.000% Fannie Mae Pool 01/09/2045                          | 60 597                 | 0,00                    | 449 667 3.000% Fannie Mae Pool 01/04/2048                         | 414 333                | 0,02                    |
| 48 920 3.000% Fannie Mae Pool 01/11/2045                          | 44 797                 | 0,00                    | 17 087 4.000% Fannie Mae Pool 01/04/2048                          | 16 575                 | 0,00                    |
| 201 429 3.500% Fannie Mae Pool 01/11/2045                         | 190 628                | 0,01                    | 17 974 4.500% Fannie Mae Pool 01/04/2048                          | 17 870                 | 0,00                    |
| 39 114 3.500% Fannie Mae Pool 01/12/2045                          | 36 979                 | 0,00                    | 230 963 3.000% Fannie Mae Pool 01/05/2048                         | 211 392                | 0,01                    |
| 104 757 3.500% Fannie Mae Pool 01/01/2046                         | 99 040                 | 0,00                    | 143 390 4.000% Fannie Mae Pool 01/06/2048                         | 139 097                | 0,00                    |
| 202 423 4.000% Fannie Mae Pool 01/02/2046                         | 198 180                | 0,01                    | 20 687 5.000% Fannie Mae Pool 01/06/2048                          | 20 923                 | 0,00                    |
| 133 888 4.000% Fannie Mae Pool 01/03/2046                         | 131 267                | 0,01                    | 10 401 4.500% Fannie Mae Pool 01/07/2048                          | 10 341                 | 0,00                    |
| 200 396 3.000% Fannie Mae Pool 01/05/2046                         | 184 649                | 0,01                    | 33 213 4.500% Fannie Mae Pool 01/08/2048                          | 33 020                 | 0,00                    |
| 511 739 4.500% Fannie Mae Pool 01/05/2046                         | 513 690                | 0,02                    | 253 828 5.000% Fannie Mae Pool 01/09/2048                         | 256 720                | 0,01                    |
| 62 041 3.500% Fannie Mae Pool 01/06/2046                          | 58 714                 | 0,00                    | 146 833 4.000% Fannie Mae Pool 01/10/2048                         | 143 291                | 0,01                    |
| 1 135 957 3.500% Fannie Mae Pool 01/08/2046                       | 1 080 023              | 0,04                    | 23 113 4.500% Fannie Mae Pool 01/10/2048                          | 22 979                 | 0,00                    |
| 72 730 3.500% Fannie Mae Pool 01/09/2046                          | 68 761                 | 0,00                    | 131 513 3.000% Fannie Mae Pool 01/11/2048                         | 120 369                | 0,00                    |
| 481 697 4.000% Fannie Mae Pool 01/09/2046                         | 471 582                | 0,02                    | 1 069 259 3.500% Fannie Mae Pool 01/11/2048                       | 1 015 215              | 0,03                    |
| 215 183 3.000% Fannie Mae Pool 01/11/2046                         | 197 765                | 0,00                    | 182 880 4.000% Fannie Mae Pool 01/11/2048                         | 177 405                | 0,01                    |
| 426 255 4.000% Fannie Mae Pool 01/11/2046                         | 417 232                | 0,02                    | 31 279 4.500% Fannie Mae Pool 01/11/2048                          | 31 098                 | 0,00                    |
| 59 245 3.500% Fannie Mae Pool 01/12/2046                          | 55 833                 | 0,00                    | 521 181 3.000% Fannie Mae Pool 01/12/2048                         | 476 855                | 0,02                    |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 55 615 4.000% Fannie Mae Pool 01/12/2048                          | 53 950           | 0,00              | 453 245 2.500% Fannie Mae Pool 01/07/2050                         | 393 933          | 0,01              |
| 97 883 5.000% Fannie Mae Pool 01/12/2048                          | 98 998           | 0,00              | 197 597 3.000% Fannie Mae Pool 01/07/2050                         | 178 755          | 0,01              |
| 346 600 4.000% Fannie Mae Pool 01/01/2049                         | 337 739          | 0,02              | 190 555 4.000% Fannie Mae Pool 01/07/2050                         | 184 850          | 0,01              |
| 59 955 5.500% Fannie Mae Pool 01/01/2049                          | 62 138           | 0,00              | 334 995 2.000% Fannie Mae Pool 01/08/2050                         | 278 996          | 0,01              |
| 270 533 3.000% Fannie Mae Pool 01/02/2049                         | 247 609          | 0,01              | 2 287 585 2.500% Fannie Mae Pool 01/08/2050                       | 1 995 349        | 0,08              |
| 649 568 3.500% Fannie Mae Pool 01/03/2049                         | 611 662          | 0,02              | 748 914 2.500% Fannie Mae Pool 01/09/2050                         | 653 846          | 0,02              |
| 50 927 4.000% Fannie Mae Pool 01/03/2049                          | 49 302           | 0,00              | 4 706 650 2.000% Fannie Mae Pool 01/10/2050                       | 3 916 940        | 0,15              |
| 94 240 4.500% Fannie Mae Pool 01/03/2049                          | 93 695           | 0,00              | 930 790 2.500% Fannie Mae Pool 01/10/2050                         | 808 120          | 0,03              |
| 33 107 4.500% Fannie Mae Pool 01/04/2049                          | 32 854           | 0,00              | 2 331 164 2.000% Fannie Mae Pool 01/11/2050                       | 1 939 304        | 0,07              |
| 103 877 4.000% Fannie Mae Pool 01/05/2049                         | 100 562          | 0,00              | 1 250 699 2.500% Fannie Mae Pool 01/11/2050                       | 1 085 480        | 0,04              |
| 36 448 4.500% Fannie Mae Pool 01/05/2049                          | 36 236           | 0,00              | 839 962 1.500% Fannie Mae Pool 01/12/2050                         | 660 452          | 0,02              |
| 1 000 751 3.500% Fannie Mae Pool 01/06/2049                       | 942 286          | 0,04              | 2 492 798 2.000% Fannie Mae Pool 01/12/2050                       | 2 072 993        | 0,08              |
| 534 250 4.000% Fannie Mae Pool 01/06/2049                         | 519 003          | 0,02              | 1 102 063 2.500% Fannie Mae Pool 01/12/2050                       | 956 136          | 0,04              |
| 53 870 3.500% Fannie Mae Pool 01/07/2049                          | 50 552           | 0,00              | 2 512 617 2.000% Fannie Mae Pool 01/01/2051                       | 2 086 941        | 0,08              |
| 61 359 4.000% Fannie Mae Pool 01/07/2049                          | 59 401           | 0,00              | 757 280 2.500% Fannie Mae Pool 01/01/2051                         | 656 772          | 0,02              |
| 64 341 4.500% Fannie Mae Pool 01/07/2049                          | 63 848           | 0,00              | 1 417 221 3.000% Fannie Mae Pool 01/01/2051                       | 1 290 958        | 0,05              |
| 399 318 3.000% Fannie Mae Pool 01/08/2049                         | 361 410          | 0,01              | 1 429 449 1.500% Fannie Mae Pool 01/02/2051                       | 1 125 868        | 0,04              |
| 609 911 3.500% Fannie Mae Pool 01/08/2049                         | 572 344          | 0,02              | 2 176 734 2.000% Fannie Mae Pool 01/02/2051                       | 1 806 809        | 0,07              |
| 56 590 5.000% Fannie Mae Pool 01/08/2049                          | 57 234           | 0,00              | 5 398 961 2.000% Fannie Mae Pool 01/03/2051                       | 4 484 511        | 0,17              |
| 310 789 3.000% Fannie Mae Pool 01/09/2049                         | 281 285          | 0,01              | 1 926 832 2.000% Fannie Mae Pool 01/04/2051                       | 1 599 710        | 0,06              |
| 96 505 3.500% Fannie Mae Pool 01/09/2049                          | 90 561           | 0,00              | 1 879 876 2.500% Fannie Mae Pool 01/04/2051                       | 1 630 374        | 0,06              |
| 39 702 4.500% Fannie Mae Pool 01/09/2049                          | 39 398           | 0,00              | 8 429 507 2.000% Fannie Mae Pool 01/05/2051                       | 6 997 325        | 0,26              |
| 754 898 4.000% Fannie Mae Pool 01/10/2049                         | 742 845          | 0,03              | 1 174 483 3.000% Fannie Mae Pool 01/05/2051                       | 1 062 943        | 0,04              |
| 199 209 4.500% Fannie Mae Pool 01/10/2049                         | 199 012          | 0,01              | 579 413 2.500% Fannie Mae Pool 01/06/2051                         | 501 084          | 0,02              |
| 63 356 5.000% Fannie Mae Pool 01/10/2049                          | 64 078           | 0,00              | 1 263 448 3.000% Fannie Mae Pool 01/06/2051                       | 1 151 020        | 0,04              |
| 36 205 2.500% Fannie Mae Pool 01/11/2049                          | 31 564           | 0,00              | 2 316 971 2.000% Fannie Mae Pool 01/07/2051                       | 1 921 455        | 0,07              |
| 76 172 3.000% Fannie Mae Pool 01/11/2049                          | 68 941           | 0,00              | 1 993 308 2.500% Fannie Mae Pool 01/08/2051                       | 1 721 984        | 0,06              |
| 2 566 674 3.000% Fannie Mae Pool 01/12/2049                       | 2 328 775        | 0,09              | 1 135 027 1.500% Fannie Mae Pool 01/09/2051                       | 893 742          | 0,03              |
| 79 439 2.500% Fannie Mae Pool 01/02/2050                          | 69 254           | 0,00              | 2 475 516 2.500% Fannie Mae Pool 01/09/2051                       | 2 145 589        | 0,08              |
| 120 509 3.000% Fannie Mae Pool 01/02/2050                         | 109 068          | 0,00              | 447 652 3.000% Fannie Mae Pool 01/09/2051                         | 402 089          | 0,02              |
| 476 946 3.500% Fannie Mae Pool 01/02/2050                         | 452 087          | 0,02              | 1 738 643 2.500% Fannie Mae Pool 01/10/2051                       | 1 500 364        | 0,05              |
| 73 201 4.000% Fannie Mae Pool 01/02/2050                          | 70 865           | 0,00              | 937 333 1.500% Fannie Mae Pool 01/11/2051                         | 737 497          | 0,03              |
| 49 811 4.500% Fannie Mae Pool 01/03/2050                          | 49 429           | 0,00              | 2 583 935 2.000% Fannie Mae Pool 01/11/2051                       | 2 139 636        | 0,08              |
| 153 862 5.000% Fannie Mae Pool 01/03/2050                         | 155 558          | 0,01              | 2 810 570 2.000% Fannie Mae Pool 01/01/2052                       | 2 324 063        | 0,09              |
| 503 868 3.000% Fannie Mae Pool 01/04/2050                         | 456 114          | 0,02              | 1 239 542 2.500% Fannie Mae Pool 01/01/2052                       | 1 069 007        | 0,04              |
| 101 065 4.500% Fannie Mae Pool 01/04/2050                         | 100 086          | 0,00              | 1 661 580 2.000% Fannie Mae Pool 01/02/2052                       | 1 376 760        | 0,05              |
| 454 585 3.000% Fannie Mae Pool 01/05/2050                         | 411 413          | 0,02              | 5 712 335 2.500% Fannie Mae Pool 01/02/2052                       | 4 931 068        | 0,19              |
| 171 780 3.500% Fannie Mae Pool 01/05/2050                         | 160 877          | 0,01              | 551 497 3.000% Fannie Mae Pool 01/02/2052                         | 496 726          | 0,02              |
| 432 502 4.000% Fannie Mae Pool 01/05/2050                         | 418 667          | 0,02              | 2 873 098 2.000% Fannie Mae Pool 01/03/2052                       | 2 394 993        | 0,09              |
| 1 564 942 2.500% Fannie Mae Pool 01/06/2050                       | 1 363 544        | 0,05              | 695 697 2.000% Fannie Mae Pool 01/04/2052                         | 574 725          | 0,02              |
| 991 584 3.000% Fannie Mae Pool 01/06/2050                         | 897 222          | 0,03              | 951 700 2.500% Fannie Mae Pool 01/04/2052                         | 819 906          | 0,03              |
| 92 335 3.500% Fannie Mae Pool 01/06/2050                          | 86 445           | 0,00              | 246 698 3.000% Fannie Mae Pool 01/04/2052                         | 221 401          | 0,01              |
| 317 595 2.000% Fannie Mae Pool 01/07/2050                         | 264 603          | 0,01              | 684 125 2.500% Fannie Mae Pool 01/05/2052                         | 596 983          | 0,02              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD                                  | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets                                |         |      |
|---|---|-------------------|---|------------------|--|---------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |   |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |  |         |      |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |   |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |  |         |      |
| <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |   |                   | <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |  |         |      |
| 2 238 530 3.000%  | Fannie Mae Pool 01/05/2052                        | 2 006 879         | 0,08  | 200 000 4.500%   | Federal Home Loan Banks 03/10/2024               | 200 408 | 0,01 |
| 990 088 3.500%  | Fannie Mae Pool 01/05/2052                        | 925 097           | 0,03  | 400 000 0.660%   | Federal Home Loan Banks 28/10/2024               | 375 912 | 0,01 |
| 496 274 3.000%  | Fannie Mae Pool 01/06/2052                        | 448 055           | 0,02  | 500 000 1.250%   | Federal Home Loan Banks 28/01/2025               | 471 385 | 0,02 |
| 578 309 3.500%  | Fannie Mae Pool 01/06/2052                        | 536 886           | 0,02  | 200 000 0.500%   | Federal Home Loan Banks 14/04/2025               | 186 002 | 0,01 |
| 438 412 4.000%  | Fannie Mae Pool 01/07/2052                        | 422 872           | 0,02  | 300 000 0.375%   | Federal Home Loan Banks 04/09/2025               | 274 575 | 0,01 |
| 583 775 4.000%  | Fannie Mae Pool 01/08/2052                        | 564 237           | 0,02  | 100 000 1.250%   | Federal Home Loan Banks 21/12/2026               | 90 658  | 0,00 |
| 3 254 939 4.500%  | Fannie Mae Pool 01/08/2052                        | 3 187 192         | 0,12  | 400 000 3.250%   | Federal Home Loan Banks 16/11/2028               | 389 404 | 0,01 |
| 2 323 782 4.000%  | Fannie Mae Pool 01/10/2052                        | 2 220 906         | 0,08  | 100 000 5.500%   | Federal Home Loan Banks 15/07/2036               | 115 193 | 0,00 |
| 219 868 5.000%  | Fannie Mae Pool 01/10/2052                        | 220 667           | 0,01  | 500 000 1.500%   | Federal Home Loan Mortgage Corp 12/02/2025       | 475 855 | 0,02 |
| 194 042 5.500%  | Fannie Mae Pool 01/12/2052                        | 198 165           | 0,01  | 600 000 0.375%   | Federal Home Loan Mortgage Corp 21/07/2025       | 551 268 | 0,02 |
| 817 447 5.000%  | Fannie Mae Pool 01/02/2053                        | 814 865           | 0,03  | 400 000 0.375%   | Federal Home Loan Mortgage Corp 23/09/2025       | 365 544 | 0,01 |
| 223 494 5.500%  | Fannie Mae Pool 01/02/2053                        | 228 663           | 0,01  | 100 000 1.750%   | Federal National Mortgage Association 02/07/2024 | 96 475  | 0,00 |
| 979 595 6.000%  | Fannie Mae Pool 01/02/2053                        | 999 516           | 0,04  | 200 000 1.625%   | Federal National Mortgage Association 15/10/2024 | 192 166 | 0,01 |
| 30 482 2.801%   | Fannie Mae-Aces 25/06/2025                        | 29 357            | 0,00  | 200 000 1.625%   | Federal National Mortgage Association 07/01/2025 | 191 200 | 0,01 |
| 70 788 2.670%   | Fannie Mae-Aces 25/12/2026                        | 66 725            | 0,00  | 300 000 0.625%   | Federal National Mortgage Association 22/04/2025 | 279 210 | 0,01 |
| 78 988 3.058%   | Fannie Mae-Aces 25/09/2027                        | 75 289            | 0,00  | 400 000 0.500%   | Federal National Mortgage Association 17/06/2025 | 369 636 | 0,01 |
| 123 320 2.972%  | Fannie Mae-Aces 25/11/2027                        | 116 647           | 0,00  | 200 000 0.550%   | Federal National Mortgage Association 19/08/2025 | 182 954 | 0,01 |
| 332 711 2.999%  | Fannie Mae-Aces 25/01/2028                        | 315 447           | 0,01  | 400 000 0.375%   | Federal National Mortgage Association 25/08/2025 | 366 316 | 0,01 |
| 91 992 3.150%   | Fannie Mae-Aces 25/03/2028                        | 87 577            | 0,00  | 300 000 0.500%   | Federal National Mortgage Association 07/11/2025 | 274 533 | 0,01 |
| 716 928 3.697%  | Fannie Mae-Aces 25/08/2028                        | 695 830           | 0,03  | 100 000 1.875%   | Federal National Mortgage Association 24/09/2026 | 93 644  | 0,00 |
| 128 221 2.937%  | Fannie Mae-Aces 25/06/2029                        | 119 970           | 0,00  | 500 000 0.750%   | Federal National Mortgage Association 08/10/2027 | 438 110 | 0,02 |
| 274 911 2.980%  | Fannie Mae-Aces 25/08/2029                        | 256 559           | 0,01  | 200 000 0.875%   | Federal National Mortgage Association 05/08/2030 | 163 008 | 0,01 |
| 75 000 1.435%   | Fannie Mae-Aces 25/10/2029                        | 63 138            | 0,00  | 28 600 2.500%    | Freddie Mac Gold Pool 01/10/2028                 | 27 570  | 0,00 |
| 48 200 1.821%   | Fannie Mae-Aces 25/02/2030                        | 41 433            | 0,00  | 52 269 3.000%    | Freddie Mac Gold Pool 01/09/2032                 | 50 105  | 0,00 |
| 145 000 1.507%  | Fannie Mae-Aces 25/03/2031                        | 117 608           | 0,00  | 95 671 3.500%    | Freddie Mac Gold Pool 01/09/2032                 | 93 756  | 0,00 |
| 200 000 1.714%  | Fannie Mae-Aces 25/07/2031                        | 164 696           | 0,01  |                  |  |         |      |
| 100 000 3.250%  | Federal Farm Credit Banks Funding Corp 17/06/2024 | 98 199            | 0,00  |                  |  |         |      |
| 200 000 4.500%  | Federal Farm Credit Banks Funding Corp 18/11/2024 | 200 382           | 0,01  |                  |  |         |      |
| 25 000 1.750%   | Federal Farm Credit Banks Funding Corp 14/02/2025 | 23 861            | 0,00  |                  |  |         |      |
| 150 000 1.750%  | Federal Farm Credit Banks Funding Corp 25/02/2025 | 143 144           | 0,01  |                  |  |         |      |
| 100 000 3.875%  | Federal Farm Credit Banks Funding Corp 02/02/2026 | 99 270            | 0,00  |                  |  |         |      |
| 100 000 3.000%  | Federal Farm Credit Banks Funding Corp 03/08/2026 | 96 684            | 0,00  |                  |  |         |      |
| 200 000 4.000%  | Federal Farm Credit Banks Funding Corp 06/01/2028 | 200 644           | 0,01  |                  |  |         |      |
| 200 000 2.750%  | Federal Home Loan Banks 28/06/2024                | 195 760           | 0,01  |                  |  |         |      |
| 200 000 3.000%  | Federal Home Loan Banks 08/07/2024                | 196 390           | 0,01  |                  |  |         |      |
| 100 000 4.875%  | Federal Home Loan Banks 13/09/2024                | 100 598           | 0,00  |                  |  |         |      |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                            |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>                            |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 65 061 2.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/11/2032                 | 60 757           | 0,00              | 14 176 4.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/01/2048  | 14 155           | 0,00              |
| 50 046 2.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/12/2032                 | 46 735           | 0,00              | 48 324 3.000% Freddie Mac Gold Pool<br>01/02/2048  | 44 259           | 0,00              |
| 34 578 2.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/02/2033                 | 32 290           | 0,00              | 61 291 4.000% Freddie Mac Gold Pool<br>01/03/2048  | 59 515           | 0,00              |
| 43 761 3.000% Freddie Mac Gold Pool<br>01/02/2033                 | 41 950           | 0,00              | 45 937 3.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/04/2048  | 43 285           | 0,00              |
| 28 322 3.000% Freddie Mac Gold Pool<br>01/05/2033                 | 27 105           | 0,00              | 22 306 3.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/05/2048  | 21 018           | 0,00              |
| 193 958 3.000% Freddie Mac Gold Pool<br>01/06/2033                | 185 286          | 0,01              | 82 920 4.000% Freddie Mac Gold Pool<br>01/05/2048  | 80 589           | 0,00              |
| 232 607 3.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/01/2044                | 221 285          | 0,01              | 10 113 3.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/07/2048  | 9 529            | 0,00              |
| 54 938 3.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/12/2044                 | 52 286           | 0,00              | 29 855 4.000% Freddie Mac Gold Pool<br>01/07/2048  | 28 990           | 0,00              |
| 56 840 4.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/07/2045                 | 57 121           | 0,00              | 17 869 4.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/07/2048  | 17 783           | 0,00              |
| 323 138 3.000% Freddie Mac Gold Pool<br>01/08/2045                | 298 186          | 0,01              | 14 272 5.000% Freddie Mac Gold Pool<br>01/07/2048  | 14 450           | 0,00              |
| 32 159 4.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/12/2045                 | 32 310           | 0,00              | 7 877 3.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/08/2048   | 7 422            | 0,00              |
| 70 003 4.000% Freddie Mac Gold Pool<br>01/01/2046                 | 68 591           | 0,00              | 8 175 4.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/09/2048   | 8 135            | 0,00              |
| 63 676 4.000% Freddie Mac Gold Pool<br>01/07/2046                 | 62 380           | 0,00              | 19 191 4.000% Freddie Mac Gold Pool<br>01/10/2048  | 18 635           | 0,00              |
| 104 253 3.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/08/2046                | 98 660           | 0,00              | 13 484 4.000% Freddie Mac Gold Pool<br>01/12/2048  | 13 093           | 0,00              |
| 59 774 3.000% Freddie Mac Gold Pool<br>01/10/2046                 | 54 764           | 0,00              | 36 675 4.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/12/2048  | 36 498           | 0,00              |
| 66 714 3.000% Freddie Mac Gold Pool<br>01/12/2046                 | 61 122           | 0,00              | 66 621 4.000% Freddie Mac Gold Pool<br>01/03/2049  | 64 690           | 0,00              |
| 55 029 4.000% Freddie Mac Gold Pool<br>01/01/2047                 | 53 653           | 0,00              | 500 000 3.303% Freddie Mac Multifamily<br>Structured Pass Through Certificates<br>25/07/2024 | 489 567          | 0,02              |
| 59 929 3.000% Freddie Mac Gold Pool<br>01/02/2047                 | 54 906           | 0,00              | 100 000 3.241% Freddie Mac Multifamily<br>Structured Pass Through Certificates<br>25/09/2024 | 97 644           | 0,00              |
| 65 822 3.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/02/2047                 | 62 093           | 0,00              | 200 000 3.161% Freddie Mac Multifamily<br>Structured Pass Through Certificates<br>25/05/2025 | 194 981          | 0,01              |
| 112 354 3.000% Freddie Mac Gold Pool<br>01/04/2047                | 102 937          | 0,00              | 101 000 3.151% Freddie Mac Multifamily<br>Structured Pass Through Certificates<br>25/11/2025 | 97 849           | 0,00              |
| 33 513 3.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/08/2047                 | 31 589           | 0,00              | 75 000 2.525% Freddie Mac Multifamily<br>Structured Pass Through Certificates<br>25/10/2026  | 70 739           | 0,00              |
| 130 852 3.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/09/2047                | 123 650          | 0,00              | 100 000 3.303% Freddie Mac Multifamily<br>Structured Pass Through Certificates<br>25/11/2027 | 96 169           | 0,00              |
| 102 559 3.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/11/2047                | 96 671           | 0,00              | 150 000 3.444% Freddie Mac Multifamily<br>Structured Pass Through Certificates<br>25/12/2027 | 144 956          | 0,01              |
| 37 913 3.500% Freddie Mac Gold Pool<br>01/01/2048                 | 35 736           | 0,00              |  |                  |                   |
| 31 755 4.000% Freddie Mac Gold Pool<br>01/01/2048                 | 30 881           | 0,00              |  |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                      |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                        |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>                      |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>                        |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>  |                  |                   | <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 50 000 3.600% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/01/2028  | 48 641           | 0,00              | 393 333 1.621% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/12/2030   | 325 975          | 0,01              |
| 85 000 3.900% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/04/2028  | 83 777           | 0,00              | 350 000 2.074% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/01/2031   | 299 802          | 0,01              |
| 350 000 1.770% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/05/2028 | 311 359          | 0,01              | 500 000 2.108% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/01/2031   | 428 988          | 0,02              |
| 250 000 3.854% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/06/2028 | 245 668          | 0,01              | 1 000 000 2.920% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/06/2032 | 900 173          | 0,03              |
| 442 000 4.050% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/09/2028 | 438 250          | 0,02              | 1 000 000 3.990% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/05/2033 | 984 384          | 0,04              |
| 350 000 3.780% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/10/2028 | 341 133          | 0,01              | 44 000 1.940% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/02/2035    | 34 415           | 0,00              |
| 121 000 4.060% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/10/2028 | 119 568          | 0,00              | 200 000 1.860% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/10/2035   | 152 392          | 0,01              |
| 500 000 3.771% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/12/2028 | 488 875          | 0,02              | 75 000 2.013% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/12/2035    | 57 720           | 0,00              |
| 140 000 2.785% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/06/2029 | 129 196          | 0,00              | 65 000 2.438% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/02/2036    | 52 029           | 0,00              |
| 140 000 2.425% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/08/2029 | 126 136          | 0,00              | 326 786 1.477% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/06/2053   | 273 360          | 0,01              |
| 125 000 2.595% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/09/2029 | 113 671          | 0,00              | 196 429 2.000% Freddie Mac Pool 01/11/2027   | 186 591          | 0,01              |
| 600 000 2.253% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/01/2030 | 531 644          | 0,02              | 83 740 3.000% Freddie Mac Pool 01/02/2031  | 80 197           | 0,00              |
| 180 000 1.558% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/04/2030 | 151 258          | 0,01              | 112 925 2.500% Freddie Mac Pool 01/02/2032   | 106 364          | 0,00              |
| 75 000 1.350% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/05/2030  | 61 929           | 0,00              | 29 808 3.500% Freddie Mac Pool 01/03/2034  | 28 970           | 0,00              |
| 50 000 1.341% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/06/2030  | 41 178           | 0,00              | 241 457 2.500% Freddie Mac Pool 01/02/2035   | 225 090          | 0,01              |
| 100 000 1.383% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/06/2030 | 82 371           | 0,00              | 261 253 3.000% Freddie Mac Pool 01/03/2035   | 248 723          | 0,01              |
| 250 000 1.500% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/10/2030 | 205 821          | 0,01              | 473 589 3.000% Freddie Mac Pool 01/05/2035   | 450 703          | 0,02              |
| 100 000 1.547% Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 25/10/2030 | 82 549           | 0,00              | 212 481 2.000% Freddie Mac Pool 01/10/2035   | 192 522          | 0,01              |
|  |                  |                   | 845 355 2.000% Freddie Mac Pool 01/01/2036   | 765 947          | 0,03              |
|  |                  |                   | 1 788 263 1.500% Freddie Mac Pool 01/06/2036   | 1 579 357        | 0,06              |
|  |                  |                   | 591 613 2.000% Freddie Mac Pool 01/06/2036   | 535 223          | 0,02              |
|  |                  |                   | 759 776 1.500% Freddie Mac Pool 01/11/2036   | 669 577          | 0,03              |
|  |                  |                   | 438 298 2.000% Freddie Mac Pool 01/01/2037   | 396 521          | 0,01              |
|  |                  |                   | 914 518 2.500% Freddie Mac Pool 01/01/2037   | 849 029          | 0,03              |
|  |                  |                   | 1 292 243 1.500% Freddie Mac Pool 01/02/2037   | 1 138 831        | 0,04              |
|  |                  |                   | 496 320 2.000% Freddie Mac Pool 01/03/2037   | 449 013          | 0,02              |
|  |                  |                   | 944 084 1.500% Freddie Mac Pool 01/04/2037   | 830 202          | 0,03              |
|  |                  |                   | 935 145 2.000% Freddie Mac Pool 01/04/2037   | 844 076          | 0,03              |
|  |                  |                   | 162 440 3.000% Freddie Mac Pool 01/12/2037   | 152 763          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 80 020 4.500% Freddie Mac Pool 01/08/2040                         | 80 339           | 0,00              | 1 004 883 2.500% Freddie Mac Pool 01/09/2050                      | 872 762          | 0,03              |
| 2 119 476 2.000% Freddie Mac Pool 01/07/2041                      | 1 810 027        | 0,07              | 1 022 044 2.000% Freddie Mac Pool 01/10/2050                      | 850 789          | 0,03              |
| 676 601 2.000% Freddie Mac Pool 01/10/2041                        | 577 343          | 0,02              | 844 579 2.500% Freddie Mac Pool 01/10/2050                        | 733 272          | 0,03              |
| 927 180 1.500% Freddie Mac Pool 01/01/2042                        | 762 601          | 0,03              | 463 976 2.500% Freddie Mac Pool 01/11/2050                        | 402 685          | 0,02              |
| 938 631 2.000% Freddie Mac Pool 01/01/2042                        | 800 278          | 0,03              | 334 042 1.500% Freddie Mac Pool 01/12/2050                        | 262 662          | 0,01              |
| 366 688 2.500% Freddie Mac Pool 01/02/2042                        | 324 225          | 0,01              | 1 312 767 3.000% Freddie Mac Pool 01/12/2050                      | 1 196 586        | 0,05              |
| 640 196 2.000% Freddie Mac Pool 01/03/2042                        | 547 697          | 0,02              | 1 974 448 2.000% Freddie Mac Pool 01/01/2051                      | 1 653 251        | 0,06              |
| 887 824 2.000% Freddie Mac Pool 01/04/2042                        | 759 393          | 0,03              | 1 884 430 2.500% Freddie Mac Pool 01/01/2051                      | 1 634 327        | 0,06              |
| 347 428 3.500% Freddie Mac Pool 01/06/2042                        | 327 684          | 0,01              | 1 411 115 2.000% Freddie Mac Pool 01/02/2051                      | 1 172 590        | 0,04              |
| 311 541 2.500% Freddie Mac Pool 01/08/2042                        | 275 408          | 0,01              | 1 011 079 2.500% Freddie Mac Pool 01/02/2051                      | 876 574          | 0,03              |
| 292 120 4.000% Freddie Mac Pool 01/11/2045                        | 285 071          | 0,01              | 874 847 1.500% Freddie Mac Pool 01/04/2051                        | 688 963          | 0,03              |
| 125 173 3.500% Freddie Mac Pool 01/12/2045                        | 118 344          | 0,00              | 883 407 1.500% Freddie Mac Pool 01/05/2051                        | 695 614          | 0,03              |
| 41 272 4.000% Freddie Mac Pool 01/03/2046                         | 40 201           | 0,00              | 248 556 1.500% Freddie Mac Pool 01/06/2051                        | 195 693          | 0,01              |
| 544 412 3.000% Freddie Mac Pool 01/07/2046                        | 498 493          | 0,02              | 1 487 246 2.000% Freddie Mac Pool 01/06/2051                      | 1 233 839        | 0,05              |
| 674 076 3.000% Freddie Mac Pool 01/08/2046                        | 616 959          | 0,02              | 2 337 002 2.500% Freddie Mac Pool 01/06/2051                      | 2 015 665        | 0,08              |
| 520 554 3.000% Freddie Mac Pool 01/04/2047                        | 476 647          | 0,02              | 176 320 3.000% Freddie Mac Pool 01/06/2051                        | 158 511          | 0,01              |
| 980 192 4.000% Freddie Mac Pool 01/10/2047                        | 960 797          | 0,04              | 2 210 557 2.500% Freddie Mac Pool 01/08/2051                      | 1 912 671        | 0,07              |
| 87 807 3.500% Freddie Mac Pool 01/02/2048                         | 82 684           | 0,00              | 3 168 819 2.000% Freddie Mac Pool 01/09/2051                      | 2 622 204        | 0,10              |
| 182 086 3.000% Freddie Mac Pool 01/09/2048                        | 166 657          | 0,01              | 591 446 2.500% Freddie Mac Pool 01/09/2051                        | 510 664          | 0,02              |
| 409 032 4.500% Freddie Mac Pool 01/09/2048                        | 406 662          | 0,02              | 1 699 070 1.500% Freddie Mac Pool 01/11/2051                      | 1 336 839        | 0,05              |
| 123 500 4.500% Freddie Mac Pool 01/10/2048                        | 122 784          | 0,00              | 2 533 553 2.000% Freddie Mac Pool 01/11/2051                      | 2 097 933        | 0,08              |
| 38 989 5.000% Freddie Mac Pool 01/11/2048                         | 39 434           | 0,00              | 4 154 869 2.500% Freddie Mac Pool 01/11/2051                      | 3 583 512        | 0,13              |
| 69 706 4.500% Freddie Mac Pool 01/04/2049                         | 69 171           | 0,00              | 1 822 401 2.000% Freddie Mac Pool 01/12/2051                      | 1 517 291        | 0,06              |
| 205 588 3.500% Freddie Mac Pool 01/07/2049                        | 192 923          | 0,01              | 4 013 161 2.500% Freddie Mac Pool 01/12/2051                      | 3 459 421        | 0,13              |
| 47 112 3.500% Freddie Mac Pool 01/08/2049                         | 44 210           | 0,00              | 4 572 844 2.000% Freddie Mac Pool 01/02/2052                      | 3 793 926        | 0,15              |
| 134 264 4.500% Freddie Mac Pool 01/08/2049                        | 133 235          | 0,01              | 1 156 048 2.500% Freddie Mac Pool 01/02/2052                      | 1 004 116        | 0,04              |
| 943 346 3.500% Freddie Mac Pool 01/09/2049                        | 894 570          | 0,03              | 741 719 3.000% Freddie Mac Pool 01/02/2052                        | 668 065          | 0,03              |
| 70 594 4.000% Freddie Mac Pool 01/09/2049                         | 68 342           | 0,00              | 1 138 547 2.000% Freddie Mac Pool 01/03/2052                      | 940 481          | 0,04              |
| 245 849 3.000% Freddie Mac Pool 01/10/2049                        | 222 513          | 0,01              | 1 924 927 3.000% Freddie Mac Pool 01/03/2052                      | 1 726 032        | 0,06              |
| 76 535 2.500% Freddie Mac Pool 01/11/2049                         | 66 722           | 0,00              | 1 644 533 2.500% Freddie Mac Pool 01/04/2052                      | 1 431 191        | 0,05              |
| 65 919 3.500% Freddie Mac Pool 01/11/2049                         | 61 858           | 0,00              | 766 633 2.500% Freddie Mac Pool 01/05/2052                        | 660 426          | 0,02              |
| 81 272 3.000% Freddie Mac Pool 01/01/2050                         | 73 558           | 0,00              | 496 128 4.000% Freddie Mac Pool 01/08/2052                        | 481 972          | 0,02              |
| 267 996 3.000% Freddie Mac Pool 01/02/2050                        | 242 559          | 0,01              | 1 352 679 5.000% Freddie Mac Pool 01/10/2052                      | 1 351 017        | 0,05              |
| 362 517 4.000% Freddie Mac Pool 01/02/2050                        | 350 948          | 0,01              | 814 200 4.500% Freddie Mac Pool 01/12/2052                        | 805 017          | 0,03              |
| 84 934 3.500% Freddie Mac Pool 01/03/2050                         | 79 701           | 0,00              | 443 707 5.000% Freddie Mac Pool 01/12/2052                        | 447 571          | 0,02              |
| 70 788 5.000% Freddie Mac Pool 01/03/2050                         | 71 569           | 0,00              | 49 725 5.500% Freddie Mac Pool 01/12/2052                         | 51 167           | 0,00              |
| 1 039 317 3.000% Freddie Mac Pool 01/04/2050                      | 940 819          | 0,04              | 819 050 5.000% Freddie Mac Pool 01/02/2053                        | 816 463          | 0,03              |
| 218 933 2.500% Freddie Mac Pool 01/05/2050                        | 190 420          | 0,01              | 1 582 022 5.500% Freddie Mac Pool 01/02/2053                      | 1 598 012        | 0,06              |
| 417 454 3.000% Freddie Mac Pool 01/05/2050                        | 377 810          | 0,01              | 390 789 6.500% Freddie Mac Pool 01/02/2053                        | 403 222          | 0,02              |
| 552 060 3.500% Freddie Mac Pool 01/05/2050                        | 517 008          | 0,02              | 269 056 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/12/2041                      | 258 567          | 0,01              |
| 266 808 4.000% Freddie Mac Pool 01/06/2050                        | 258 279          | 0,01              | 151 402 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/01/2042                      | 149 214          | 0,01              |
| 693 309 2.500% Freddie Mac Pool 01/07/2050                        | 602 583          | 0,02              | 629 269 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/10/2042                      | 585 989          | 0,02              |
| 1 045 420 2.000% Freddie Mac Pool 01/09/2050                      | 870 332          | 0,03              | 204 276 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/12/2042                      | 190 227          | 0,01              |



## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 169 003 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/12/2042                      | 162 449          | 0,01              | 121 603 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/12/2047                      | 115 774          | 0,00              |
| 163 638 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/01/2043                      | 152 383          | 0,01              | 195 535 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/12/2047                      | 190 966          | 0,01              |
| 116 952 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/01/2043                      | 112 417          | 0,00              | 12 989 4.500% Ginnie Mae II Pool 20/12/2047                       | 12 970           | 0,00              |
| 218 262 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/05/2043                      | 209 731          | 0,01              | 21 720 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/01/2048                       | 20 080           | 0,00              |
| 220 531 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/06/2043                      | 205 352          | 0,01              | 133 844 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/01/2048                      | 127 428          | 0,00              |
| 29 758 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/10/2043                       | 29 300           | 0,00              | 7 051 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/01/2048                        | 6 886            | 0,00              |
| 47 458 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/01/2044                       | 46 727           | 0,00              | 17 962 4.500% Ginnie Mae II Pool 20/01/2048                       | 17 936           | 0,00              |
| 65 436 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/07/2044                       | 64 351           | 0,00              | 50 001 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/02/2048                       | 46 226           | 0,00              |
| 70 691 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/08/2044                       | 69 519           | 0,00              | 39 205 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/02/2048                       | 37 326           | 0,00              |
| 112 207 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/09/2044                      | 107 702          | 0,00              | 124 886 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/02/2048                      | 122 065          | 0,00              |
| 173 812 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/04/2045                      | 166 145          | 0,01              | 91 880 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/03/2048                       | 87 284           | 0,00              |
| 23 665 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/05/2045                       | 21 903           | 0,00              | 175 940 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/03/2048                      | 171 829          | 0,01              |
| 214 633 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/06/2045                      | 198 645          | 0,01              | 12 035 4.500% Ginnie Mae II Pool 20/03/2048                       | 12 018           | 0,00              |
| 41 376 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/07/2045                       | 40 620           | 0,00              | 20 775 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/05/2048                       | 20 247           | 0,00              |
| 56 580 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/10/2045                       | 54 084           | 0,00              | 39 434 5.000% Ginnie Mae II Pool 20/05/2048                       | 40 061           | 0,00              |
| 23 627 4.500% Ginnie Mae II Pool 20/10/2045                       | 23 866           | 0,00              | 282 425 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/06/2048                      | 275 244          | 0,01              |
| 122 103 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/11/2045                      | 116 717          | 0,00              | 19 454 4.500% Ginnie Mae II Pool 20/06/2048                       | 19 426           | 0,00              |
| 42 431 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/11/2045                       | 41 656           | 0,00              | 55 345 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/07/2048                       | 53 938           | 0,00              |
| 152 665 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/12/2045                      | 141 293          | 0,01              | 111 456 4.500% Ginnie Mae II Pool 20/07/2048                      | 111 292          | 0,00              |
| 43 107 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/12/2045                       | 41 205           | 0,00              | 187 824 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/08/2048                      | 183 047          | 0,01              |
| 53 989 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/01/2046                       | 49 968           | 0,00              | 13 646 4.500% Ginnie Mae II Pool 20/08/2048                       | 13 626           | 0,00              |
| 663 286 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/01/2046                      | 634 025          | 0,02              | 463 580 4.500% Ginnie Mae II Pool 20/09/2048                      | 462 901          | 0,02              |
| 114 927 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/05/2046                      | 109 477          | 0,00              | 20 169 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/10/2048                       | 19 656           | 0,00              |
| 157 537 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/06/2046                      | 145 718          | 0,01              | 12 614 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/11/2048                       | 12 293           | 0,00              |
| 346 048 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/07/2046                      | 320 085          | 0,01              | 26 328 5.000% Ginnie Mae II Pool 20/11/2048                       | 26 735           | 0,00              |
| 162 121 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/08/2046                      | 149 958          | 0,01              | 125 783 4.500% Ginnie Mae II Pool 20/12/2048                      | 125 598          | 0,00              |
| 62 765 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/09/2046                       | 58 055           | 0,00              | 364 886 4.500% Ginnie Mae II Pool 20/01/2049                      | 363 782          | 0,01              |
| 116 018 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/10/2046                      | 107 313          | 0,00              | 37 168 5.000% Ginnie Mae II Pool 20/01/2049                       | 37 743           | 0,00              |
| 53 348 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/11/2046                       | 49 346           | 0,00              | 28 552 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/03/2049                       | 27 826           | 0,00              |
| 80 255 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/11/2046                       | 76 450           | 0,00              | 63 492 4.500% Ginnie Mae II Pool 20/04/2049                       | 63 398           | 0,00              |
| 196 016 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/12/2046                      | 181 310          | 0,01              | 64 773 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/05/2049                       | 63 061           | 0,00              |
| 119 532 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/12/2046                      | 113 865          | 0,00              | 29 193 4.500% Ginnie Mae II Pool 20/06/2049                       | 29 150           | 0,00              |
| 278 669 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/01/2047                      | 265 456          | 0,01              | 140 947 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/07/2049                      | 137 221          | 0,01              |
| 55 866 2.500% Ginnie Mae II Pool 20/02/2047                       | 49 962           | 0,00              | 18 757 5.000% Ginnie Mae II Pool 20/07/2049                       | 19 055           | 0,00              |
| 580 843 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/02/2047                      | 537 264          | 0,02              | 210 244 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/09/2049                      | 193 475          | 0,01              |
| 17 819 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/02/2047                       | 16 974           | 0,00              | 156 462 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/09/2049                      | 148 360          | 0,01              |
| 160 655 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/03/2047                      | 152 953          | 0,01              | 155 617 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/10/2049                      | 147 559          | 0,01              |
| 30 629 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/03/2047                       | 29 924           | 0,00              | 320 146 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/11/2049                      | 294 057          | 0,01              |
| 52 743 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/05/2047                       | 50 214           | 0,00              | 98 916 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/12/2049                       | 90 856           | 0,00              |
| 31 264 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/07/2047                       | 28 904           | 0,00              | 527 631 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/12/2049                      | 500 167          | 0,02              |
| 34 764 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/10/2047                       | 33 951           | 0,00              | 265 259 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/01/2050                      | 243 569          | 0,01              |
| 45 989 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/11/2047                       | 42 517           | 0,00              | 20 860 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/01/2050                       | 20 308           | 0,00              |
| 395 032 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/11/2047                      | 376 095          | 0,01              | 450 501 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/02/2050                      | 413 539          | 0,02              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                       | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                          |                  |                   |
| 32 336 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/03/2050                       | 30 653           | 0,00              | 617 687 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/10/2052                       | 594 223          | 0,02              |
| 97 816 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/03/2050                       | 95 230           | 0,00              | 1 213 242 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/11/2052                     | 1 167 153        | 0,04              |
| 126 920 2.500% Ginnie Mae II Pool 20/04/2050                      | 112 207          | 0,00              | 742 851 5.000% Ginnie Mae II Pool 20/12/2052                       | 743 590          | 0,03              |
| 233 083 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/04/2050                      | 213 929          | 0,01              | 1 409 537 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/12/2052                     | 1 321 006        | 0,05              |
| 143 496 2.500% Ginnie Mae II Pool 20/05/2050                      | 126 861          | 0,00              | 1 241 909 4.500% Ginnie Mae II Pool 20/12/2052                     | 1 223 039        | 0,05              |
| 1 025 467 2.500% Ginnie Mae II Pool 20/06/2050                    | 906 592          | 0,03              | 447 228 5.000% Ginnie Mae II Pool 20/12/2052                       | 447 673          | 0,02              |
| 545 519 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/06/2050                      | 500 521          | 0,02              | 621 181 5.500% Ginnie Mae II Pool 20/12/2052                       | 628 353          | 0,02              |
| 351 873 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/06/2050                      | 342 573          | 0,01              | 897 213 6.000% Ginnie Mae II Pool 20/12/2052                       | 914 336          | 0,03              |
| 434 923 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/07/2050                      | 399 425          | 0,02              | 871 230 4.500% Ginnie Mae II Pool 20/01/2053                       | 857 992          | 0,03              |
| 487 875 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/07/2050                      | 462 283          | 0,02              | 200 000 3.236% Grand Parkway Transportation Corporation 01/10/2052 | 150 316          | 0,01              |
| 1 448 858 2.500% Ginnie Mae II Pool 20/08/2050                    | 1 280 902        | 0,05              | 200 000 0.625% Hong Kong Government International Bond 02/02/2026  | 181 758          | 0,01              |
| 831 578 2.000% Ginnie Mae II Pool 20/09/2050                      | 707 937          | 0,03              | 200 000 1.750% Hong Kong Government International Bond 24/11/2031  | 169 162          | 0,01              |
| 560 582 2.500% Ginnie Mae II Pool 20/09/2050                      | 495 598          | 0,02              | 50 000 3.961% Houston (TX) 01/03/2047                              | 44 129           | 0,00              |
| 218 321 2.000% Ginnie Mae II Pool 20/10/2050                      | 185 860          | 0,01              | 200 000 2.125% Hungary Government International Bond 22/09/2031    | 153 848          | 0,01              |
| 795 104 2.500% Ginnie Mae II Pool 20/10/2050                      | 702 933          | 0,03              | 200 000 6.250% Hungary Government International Bond 22/09/2032    | 204 632          | 0,01              |
| 106 127 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/10/2050                      | 100 617          | 0,00              | 200 000 5.500% Hungary Government International Bond 16/06/2034    | 192 636          | 0,01              |
| 865 688 2.000% Ginnie Mae II Pool 20/11/2050                      | 736 976          | 0,03              | 100 000 7.625% Hungary Government International Bond 29/03/2041    | 113 035          | 0,00              |
| 494 637 2.000% Ginnie Mae II Pool 20/12/2050                      | 421 094          | 0,02              | 200 000 3.125% Hungary Government International Bond 21/09/2051    | 123 084          | 0,00              |
| 316 230 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/12/2050                      | 289 950          | 0,01              | 100 000 5.100% Illinois State 01/06/2033                           | 99 635           | 0,00              |
| 1 939 765 2.000% Ginnie Mae II Pool 20/01/2051                    | 1 651 357        | 0,06              | 100 000 6.184% Illinois State Toll Highway Authority 01/01/2034    | 111 714          | 0,00              |
| 1 413 722 2.500% Ginnie Mae II Pool 20/01/2051                    | 1 251 287        | 0,05              | 200 000 4.350% Indonesia Government International Bond 08/01/2027  | 199 482          | 0,01              |
| 1 293 015 2.000% Ginnie Mae II Pool 20/04/2051                    | 1 101 702        | 0,04              | 200 000 3.500% Indonesia Government International Bond 11/01/2028  | 192 230          | 0,01              |
| 1 750 773 2.500% Ginnie Mae II Pool 20/04/2051                    | 1 548 229        | 0,06              | 200 000 4.750% Indonesia Government International Bond 11/02/2029  | 202 362          | 0,01              |
| 872 963 2.000% Ginnie Mae II Pool 20/05/2051                      | 743 531          | 0,03              | 200 000 2.850% Indonesia Government International Bond 14/02/2030  | 181 184          | 0,01              |
| 484 937 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/06/2051                      | 458 197          | 0,02              | 200 000 2.150% Indonesia Government International Bond 28/07/2031  | 166 416          | 0,01              |
| 2 433 132 2.000% Ginnie Mae II Pool 20/07/2051                    | 2 070 868        | 0,08              | 200 000 3.550% Indonesia Government International Bond 31/03/2032  | 184 404          | 0,01              |
| 2 520 251 2.500% Ginnie Mae II Pool 20/07/2051                    | 2 223 979        | 0,08              | 200 000 4.650% Indonesia Government International Bond 20/09/2032  | 199 766          | 0,01              |
| 1 380 890 2.500% Ginnie Mae II Pool 20/08/2051                    | 1 218 228        | 0,05              | 50 000 8.500% Indonesia Government International Bond 12/10/2035   | 65 077           | 0,00              |
| 861 798 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/08/2051                      | 787 510          | 0,03              | 200 000 5.125% Indonesia Government International Bond 15/01/2045  | 196 652          | 0,01              |
| 482 554 2.000% Ginnie Mae II Pool 20/09/2051                      | 410 409          | 0,02              | 200 000 4.350% Indonesia Government International Bond 11/01/2048  | 177 976          | 0,01              |
| 1 415 108 2.500% Ginnie Mae II Pool 20/09/2051                    | 1 247 639        | 0,05              |  |                  |                   |
| 1 589 684 2.500% Ginnie Mae II Pool 20/11/2051                    | 1 400 471        | 0,05              |  |                  |                   |
| 2 089 233 2.000% Ginnie Mae II Pool 20/12/2051                    | 1 774 935        | 0,07              |  |                  |                   |
| 673 895 3.000% Ginnie Mae II Pool 20/12/2051                      | 615 053          | 0,02              |  |                  |                   |
| 2 583 958 2.000% Ginnie Mae II Pool 20/01/2052                    | 2 194 434        | 0,08              |  |                  |                   |
| 691 475 2.500% Ginnie Mae II Pool 20/01/2052                      | 608 288          | 0,02              |  |                  |                   |
| 473 180 2.000% Ginnie Mae II Pool 20/03/2052                      | 401 442          | 0,02              |  |                  |                   |
| 258 013 2.500% Ginnie Mae II Pool 20/03/2052                      | 227 003          | 0,01              |  |                  |                   |
| 1 563 558 2.000% Ginnie Mae II Pool 20/05/2052                    | 1 326 509        | 0,05              |  |                  |                   |
| 1 426 828 2.500% Ginnie Mae II Pool 20/05/2052                    | 1 255 220        | 0,05              |  |                  |                   |
| 628 773 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/06/2052                      | 589 280          | 0,02              |  |                  |                   |
| 986 097 4.000% Ginnie Mae II Pool 20/09/2052                      | 948 637          | 0,04              |  |                  |                   |
| 944 601 3.500% Ginnie Mae II Pool 20/10/2052                      | 885 271          | 0,03              |  |                  |                   |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>            |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>         |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>            |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>         |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                                    |                  |                   | <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                                 |                  |                   |
| 200 000 4.200% Indonesia Government International Bond 15/10/2050            | 172 818          | 0,01              | 400 000 2.125% Korea SMEs and Startups Agency 30/08/2026                  | 364 616          | 0,01              |
| 200 000 3.050% Indonesia Government International Bond 12/03/2051            | 147 688          | 0,01              | 200 000 5.268% KSA Sukuk Ltd 25/10/2028                                   | 208 338          | 0,01              |
| 400 000 3.350% Indonesia Government International Bond 12/03/2071            | 279 212          | 0,01              | 100 000 6.750% Los Angeles Community College District 01/08/2049          | 127 242          | 0,00              |
| 200 000 2.750% Israel Government International Bond 03/07/2030               | 181 118          | 0,01              | 100 000 5.750% Los Angeles Unified School District 01/07/2034             | 108 470          | 0,00              |
| 200 000 2.500% Japan Bank for International Cooperation 23/05/2024           | 195 152          | 0,01              | 100 000 5.456% Massachusetts State 01/12/2039                             | 108 751          | 0,00              |
| 200 000 2.875% Japan Bank for International Cooperation 14/04/2025           | 193 982          | 0,01              | 75 000 7.336% Metropolitan Transportation Authority (NY) 15/11/2039       | 95 250           | 0,00              |
| 200 000 0.625% Japan Bank for International Cooperation 15/07/2025           | 184 030          | 0,01              | 300 000 3.900% Mexico Government International Bond 27/04/2025            | 296 988          | 0,01              |
| 200 000 3.500% Japan Bank for International Cooperation 31/10/2028           | 193 444          | 0,01              | 700 000 4.150% Mexico Government International Bond 28/03/2027            | 686 846          | 0,03              |
| 200 000 2.125% Japan Bank for International Cooperation 16/02/2029           | 179 000          | 0,01              | 200 000 4.500% Mexico Government International Bond 22/04/2029            | 195 956          | 0,01              |
| 200 000 2.000% Japan Bank for International Cooperation 17/10/2029           | 175 378          | 0,01              | 200 000 2.659% Mexico Government International Bond 24/05/2031            | 167 322          | 0,01              |
| 200 000 1.250% Japan Bank for International Cooperation 21/01/2031           | 162 206          | 0,01              | 50 000 8.300% Mexico Government International Bond 15/08/2031             | 59 231           | 0,00              |
| 200 000 1.875% Japan Bank for International Cooperation 15/04/2031           | 169 410          | 0,01              | 200 000 3.500% Mexico Government International Bond 12/02/2034            | 169 640          | 0,01              |
| 200 000 2.375% Japan Finance Organization for Municipalities 13/02/2025      | 192 338          | 0,01              | 100 000 6.050% Mexico Government International Bond 11/01/2040            | 101 709          | 0,00              |
| 200 000 0.500% Kommunalbanken AS 13/01/2026                                  | 181 400          | 0,01              | 475 000 4.280% Mexico Government International Bond 14/08/2041            | 389 291          | 0,01              |
| 200 000 1.500% Kommunalbanken AS 20/01/2027                                  | 183 120          | 0,01              | 100 000 5.550% Mexico Government International Bond 21/01/2045            | 94 217           | 0,00              |
| 200 000 0.625% Kommunekredit 10/06/2025                                      | 185 212          | 0,01              | 200 000 4.500% Mexico Government International Bond 31/01/2050            | 161 478          | 0,01              |
| 200 000 2.875% Kommuninvest I Sverige AB 03/07/2024                          | 195 980          | 0,01              | 400 000 5.000% Mexico Government International Bond 27/04/2051            | 343 656          | 0,01              |
| 200 000 4.625% Kommuninvest I Sverige AB 07/08/2024                          | 200 068          | 0,01              | 200 000 4.400% Mexico Government International Bond 12/02/2052            | 156 384          | 0,01              |
| 200 000 1.750% Korea Development Bank 18/02/2025                             | 189 792          | 0,01              | 100 000 3.384% Michigan Finance Authority 01/12/2040                      | 84 219           | 0,00              |
| 400 000 1.250% Korea Development Bank 03/06/2025                             | 372 524          | 0,01              | 96 000 6.637% Municipal Electric Authority of Georgia 01/04/2057          | 105 912          | 0,00              |
| 200 000 4.000% Korea Development Bank 08/09/2025                             | 197 045          | 0,01              | 200 000 2.375% Nederlandse Waterschapsbank NV 24/03/2026                  | 190 856          | 0,01              |
| 200 000 1.125% Korea Electric Power Corp 15/06/2025                          | 184 878          | 0,01              | 200 000 5.754% New Jersey Transportation Trust Fund Authority 15/12/2028  | 205 419          | 0,01              |
| 200 000 3.875% Korea Gas Corp 13/07/2027                                     | 194 958          | 0,01              | 100 000 6.561% New Jersey Transportation Trust Fund Authority 15/12/2040  | 112 652          | 0,00              |
| 400 000 3.125% Korea Hydro & Nuclear Power Co Ltd 25/07/2027                 | 377 356          | 0,01              | 50 000 7.414% New Jersey Turnpike Authority 01/01/2040                    | 62 865           | 0,00              |
| 200 000 4.125% Korea International Bond 10/06/2044                           | 192 168          | 0,01              | 100 000 5.440% New York City Municipal Water Finance Authority 15/06/2043 | 107 849          | 0,00              |
| 200 000 1.750% Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp 15/04/2026 | 180 336          | 0,01              | 100 000 6.718% North Texas Tollway Authority 01/01/2049                   | 123 678          | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 100 000 4.910% Ohio State University 01/06/2040                   | 101 571          | 0,00              |
| 250 000 3.000% Ontario Teachers' Finance Trust 13/04/2027         | 239 525          | 0,01              |
| 150 000 5.892% Oregon State 01/06/2027                            | 156 544          | 0,01              |
| 400 000 3.750% Panama Government International Bond 16/03/2025    | 390 616          | 0,01              |
| 100 000 8.875% Panama Government International Bond 30/09/2027    | 116 358          | 0,00              |
| 300 000 3.875% Panama Government International Bond 17/03/2028    | 288 021          | 0,01              |
| 200 000 3.160% Panama Government International Bond 23/01/2030    | 175 694          | 0,01              |
| 200 000 6.400% Panama Government International Bond 14/02/2035    | 208 494          | 0,01              |
| 200 000 4.300% Panama Government International Bond 29/04/2053    | 146 940          | 0,01              |
| 200 000 4.350% Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 10/09/2024  | 200 064          | 0,01              |
| 300 000 2.300% Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 23/06/2025  | 286 047          | 0,01              |
| 200 000 1.500% Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 09/06/2026  | 183 044          | 0,01              |
| 200 000 4.400% Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 06/06/2027  | 199 282          | 0,01              |
| 200 000 4.400% Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 01/03/2028  | 199 332          | 0,01              |
| 200 000 4.450% Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 20/02/2029  | 199 648          | 0,01              |
| 300 000 2.800% Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 23/06/2030  | 268 806          | 0,01              |
| 200 000 4.700% Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 06/06/2032  | 200 512          | 0,01              |
| 200 000 3.800% Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 23/06/2050  | 160 770          | 0,01              |
| 200 000 3.550% Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 09/06/2051  | 154 550          | 0,01              |
| 100 000 2.392% Peruvian Government International Bond 23/01/2026  | 94 407           | 0,00              |
| 100 000 2.844% Peruvian Government International Bond 20/06/2030  | 87 626           | 0,00              |
| 200 000 2.783% Peruvian Government International Bond 23/01/2031  | 171 068          | 0,01              |
| 100 000 1.862% Peruvian Government International Bond 01/12/2032  | 75 727           | 0,00              |
| 50 000 8.750% Peruvian Government International Bond 21/11/2033   | 63 073           | 0,00              |
| 200 000 3.000% Peruvian Government International Bond 15/01/2034  | 163 254          | 0,01              |
| 200 000 5.625% Peruvian Government International Bond 18/11/2050  | 201 894          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>   |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>   |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                           |                  |                   |
| 150 000 2.780% Peruvian Government International Bond 01/12/2060    | 89 574           | 0,00              |
| 50 000 3.600% Peruvian Government International Bond 15/01/2072     | 33 586           | 0,00              |
| 200 000 1.950% Philippine Government International Bond 06/01/2032  | 162 732          | 0,01              |
| 200 000 3.556% Philippine Government International Bond 29/09/2032  | 183 554          | 0,01              |
| 200 000 5.609% Philippine Government International Bond 13/04/2033  | 214 096          | 0,01              |
| 100 000 6.375% Philippine Government International Bond 23/10/2034  | 112 980          | 0,00              |
| 200 000 3.700% Philippine Government International Bond 01/03/2041  | 165 832          | 0,01              |
| 200 000 3.700% Philippine Government International Bond 02/02/2042  | 165 264          | 0,01              |
| 200 000 2.650% Philippine Government International Bond 10/12/2045  | 137 552          | 0,01              |
| 200 000 3.200% Philippine Government International Bond 06/07/2046  | 148 656          | 0,01              |
| 200 000 4.200% Philippine Government International Bond 29/03/2047  | 172 762          | 0,01              |
| 160 000 4.926% Port Authority of New York and New Jersey 01/10/2051 | 163 143          | 0,01              |
| 100 000 4.458% Port Authority of New York and New Jersey 01/10/2062 | 93 338           | 0,00              |
| 200 000 1.875% Province of Alberta Canada 13/11/2024                | 192 110          | 0,01              |
| 150 000 3.300% Province of Alberta Canada 15/03/2028                | 145 713          | 0,01              |
| 100 000 2.250% Province of British Columbia Canada 02/06/2026       | 94 899           | 0,00              |
| 200 000 0.900% Province of British Columbia Canada 20/07/2026       | 181 332          | 0,01              |
| 200 000 1.300% Province of British Columbia Canada 29/01/2031       | 166 390          | 0,01              |
| 100 000 1.500% Province of Manitoba Canada 25/10/2028               | 88 064           | 0,00              |
| 200 000 0.625% Province of Ontario Canada 21/01/2026                | 182 012          | 0,01              |
| 100 000 1.050% Province of Ontario Canada 14/04/2026                | 91 539           | 0,00              |
| 200 000 2.300% Province of Ontario Canada 15/06/2026                | 189 710          | 0,01              |
| 100 000 3.100% Province of Ontario Canada 19/05/2027                | 96 883           | 0,00              |
| 100 000 2.000% Province of Ontario Canada 02/10/2029                | 89 022           | 0,00              |
| 200 000 1.600% Province of Ontario Canada 25/02/2031                | 168 448          | 0,01              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>          |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>                 |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>          |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>                 |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                                  |                  |                   | <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 1.800% Province of Ontario Canada 14/10/2031                       | 84 629           | 0,00              | 50 000 5.125% Romanian Government International Bond 15/06/2048                   | 41 955           | 0,00              |
| 200 000 2.125% Province of Ontario Canada 21/01/2032                       | 173 398          | 0,01              | 250 000 4.000% Romanian Government International Bond 14/02/2051                  | 175 728          | 0,01              |
| 300 000 2.500% Province of Quebec Canada 09/04/2024                        | 293 583          | 0,01              | 50 000 7.625% Romanian Government International Bond 17/01/2053                   | 53 620           | 0,00              |
| 75 000 2.750% Province of Quebec Canada 12/04/2027                         | 71 794           | 0,00              | 200 000 4.000% Saudi Government International Bond 17/04/2025                     | 197 990          | 0,01              |
| 100 000 1.900% Province of Quebec Canada 21/04/2031                        | 86 259           | 0,00              | 900 000 3.250% Saudi Government International Bond 26/10/2026                     | 866 493          | 0,03              |
| 250 000 0.500% PSP Capital Inc 15/09/2024                                  | 236 000          | 0,01              | 200 000 4.750% Saudi Government International Bond 18/01/2028                     | 202 572          | 0,01              |
| 300 000 3.400% Qatar Government International Bond 16/04/2025              | 293 292          | 0,01              | 400 000 4.375% Saudi Government International Bond 16/04/2029                     | 399 120          | 0,02              |
| 200 000 4.500% Qatar Government International Bond 23/04/2028              | 203 162          | 0,01              | 200 000 4.500% Saudi Government International Bond 17/04/2030                     | 199 640          | 0,01              |
| 200 000 4.000% Qatar Government International Bond 14/03/2029              | 198 732          | 0,01              | 300 000 3.250% Saudi Government International Bond 22/10/2030                     | 276 528          | 0,01              |
| 200 000 3.750% Qatar Government International Bond 16/04/2030              | 195 634          | 0,01              | 200 000 5.500% Saudi Government International Bond 25/10/2032                     | 213 590          | 0,01              |
| 200 000 5.103% Qatar Government International Bond 23/04/2048              | 203 640          | 0,01              | 200 000 2.250% Saudi Government International Bond 02/02/2033                     | 164 210          | 0,01              |
| 200 000 4.817% Qatar Government International Bond 14/03/2049              | 196 126          | 0,01              | 200 000 4.875% Saudi Government International Bond 18/07/2033                     | 201 948          | 0,01              |
| 400 000 4.400% Qatar Government International Bond 16/04/2050              | 370 888          | 0,01              | 400 000 4.500% Saudi Government International Bond 26/10/2046                     | 351 976          | 0,01              |
| 200 000 2.375% Republic of Italy Government International Bond 17/10/2024  | 191 496          | 0,01              | 200 000 4.625% Saudi Government International Bond 04/10/2047                     | 178 490          | 0,01              |
| 200 000 2.875% Republic of Italy Government International Bond 17/10/2029  | 174 182          | 0,01              | 200 000 5.000% Saudi Government International Bond 17/04/2049                     | 186 874          | 0,01              |
| 150 000 5.375% Republic of Italy Government International Bond 15/06/2033  | 150 764          | 0,01              | 200 000 5.250% Saudi Government International Bond 16/01/2050                     | 194 600          | 0,01              |
| 200 000 4.000% Republic of Italy Government International Bond 17/10/2049  | 151 332          | 0,01              | 200 000 3.750% Saudi Government International Bond 21/01/2055                     | 153 786          | 0,01              |
| 200 000 3.875% Republic of Italy Government International Bond 06/05/2051  | 143 366          | 0,01              | 200 000 0.625% SFIL SA 09/02/2026   | 181 010          | 0,01              |
| 150 000 3.250% Republic of Poland Government International Bond 06/04/2026 | 146 039          | 0,01              | 150 000 3.375% State of Israel 15/01/2050   | 115 280          | 0,00              |
| 200 000 5.500% Republic of Poland Government International Bond 16/11/2027 | 208 938          | 0,01              | 200 000 3.800% State of Israel 13/05/2060   | 156 224          | 0,01              |
| 100 000 5.750% Republic of Poland Government International Bond 16/11/2032 | 106 586          | 0,00              | 200 000 3.875% State of North Rhine-Westphalia Germany 15/01/2025                 | 198 140          | 0,01              |
| 100 000 3.000% Romanian Government International Bond 27/02/2027           | 90 898           | 0,00              | 200 000 0.750% Tennessee Valley Authority 15/05/2025                              | 185 896          | 0,01              |
| 100 000 3.000% Romanian Government International Bond 14/02/2031           | 82 499           | 0,00              | 100 000 2.875% Tennessee Valley Authority 01/02/2027                              | 96 013           | 0,00              |
| 100 000 7.125% Romanian Government International Bond 17/01/2033           | 106 185          | 0,00              | 100 000 4.250% Tennessee Valley Authority 15/09/2065                              | 93 769           | 0,00              |
| 200 000 6.000% Romanian Government International Bond 25/05/2034           | 196 106          | 0,01              | 185 000 3.922% Texas Private Activity Bond Surface Transportation Corp 31/12/2049 | 150 671          | 0,01              |
| 100 000 6.125% Romanian Government International Bond 22/01/2044           | 95 781           | 0,00              | 100 000 5.517% Texas State 01/04/2039   | 109 994          | 0,00              |
|  |                  |                   | 100 000 5.770% The New York State Urban Development Corporation 15/03/2039        | 105 397          | 0,00              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>            |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>            |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                                    |                  |                   | <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 200 000 2.000% United Arab Emirates Government International Bond 19/10/2031 | 170 950          | 0,01              | 2 800 000 3.250% United States Treasury Note/ Bond 31/08/2024     | 2 757 125        | 0,10              |
| 200 000 2.875% United Arab Emirates Government International Bond 19/10/2041 | 157 034          | 0,01              | 3 000 000 0.375% United States Treasury Note/ Bond 15/09/2024     | 2 834 180        | 0,11              |
| 14 150 000 0.000% United States Treasury Bill 13/04/2023                     | 14 132 362       | 0,53              | 700 000 1.500% United States Treasury Note/ Bond 30/09/2024       | 671 453          | 0,03              |
| 10 900 000 0.000% United States Treasury Bill 11/05/2023                     | 10 847 074       | 0,41              | 500 000 2.125% United States Treasury Note/ Bond 30/09/2024       | 484 141          | 0,02              |
| 6 000 000 0.000% United States Treasury Bill 08/06/2023                      | 5 949 851        | 0,22              | 2 500 000 4.250% United States Treasury Note/ Bond 30/09/2024     | 2 497 168        | 0,09              |
| 2 000 000 0.375% United States Treasury Note/ Bond 15/04/2024                | 1 914 062        | 0,07              | 2 500 000 0.625% United States Treasury Note/ Bond 15/10/2024     | 2 364 258        | 0,09              |
| 1 100 000 2.000% United States Treasury Note/ Bond 30/04/2024                | 1 069 621        | 0,04              | 1 200 000 1.500% United States Treasury Note/ Bond 31/10/2024     | 1 149 234        | 0,04              |
| 1 500 000 2.250% United States Treasury Note/ Bond 30/04/2024                | 1 462 500        | 0,06              | 1 100 000 2.250% United States Treasury Note/ Bond 31/10/2024     | 1 065 926        | 0,04              |
| 2 550 000 2.500% United States Treasury Note/ Bond 30/04/2024                | 2 493 223        | 0,09              | 2 500 000 4.375% United States Treasury Note/ Bond 31/10/2024     | 2 502 832        | 0,09              |
| 2 750 000 0.250% United States Treasury Note/ Bond 15/05/2024                | 2 622 061        | 0,10              | 3 000 000 0.750% United States Treasury Note/ Bond 15/11/2024     | 2 835 586        | 0,11              |
| 1 250 000 2.500% United States Treasury Note/ Bond 15/05/2024                | 1 222 168        | 0,05              | 1 300 000 2.250% United States Treasury Note/ Bond 15/11/2024     | 1 259 020        | 0,05              |
| 1 000 000 2.000% United States Treasury Note/ Bond 31/05/2024                | 971 719          | 0,04              | 850 000 1.500% United States Treasury Note/ Bond 30/11/2024       | 812 945          | 0,03              |
| 2 000 000 2.500% United States Treasury Note/ Bond 31/05/2024                | 1 954 609        | 0,07              | 1 000 000 2.125% United States Treasury Note/ Bond 30/11/2024     | 966 133          | 0,04              |
| 3 000 000 0.250% United States Treasury Note/ Bond 15/06/2024                | 2 851 992        | 0,11              | 2 500 000 4.500% United States Treasury Note/ Bond 30/11/2024     | 2 509 668        | 0,09              |
| 1 450 000 1.750% United States Treasury Note/ Bond 30/06/2024                | 1 402 762        | 0,05              | 3 000 000 1.000% United States Treasury Note/ Bond 15/12/2024     | 2 842 617        | 0,11              |
| 450 000 2.000% United States Treasury Note/ Bond 30/06/2024                  | 436 535          | 0,02              | 800 000 1.750% United States Treasury Note/ Bond 31/12/2024       | 767 406          | 0,03              |
| 2 500 000 3.000% United States Treasury Note/ Bond 30/06/2024                | 2 454 785        | 0,09              | 1 000 000 3.000% United States Treasury Note/ Bond 31/12/2024     | 967 188          | 0,04              |
| 2 500 000 0.375% United States Treasury Note/ Bond 15/07/2024                | 2 373 926        | 0,09              | 2 500 000 4.250% United States Treasury Note/ Bond 31/12/2024     | 2 502 051        | 0,09              |
| 900 000 1.750% United States Treasury Note/ Bond 31/07/2024                  | 868 992          | 0,03              | 3 000 000 1.125% United States Treasury Note/ Bond 15/01/2025     | 2 842 969        | 0,11              |
| 1 000 000 2.125% United States Treasury Note/ Bond 31/07/2024                | 970 352          | 0,04              | 1 300 000 1.375% United States Treasury Note/ Bond 31/01/2025     | 1 237 133        | 0,05              |
| 2 500 000 3.000% United States Treasury Note/ Bond 31/07/2024                | 2 454 004        | 0,09              | 400 000 2.500% United States Treasury Note/ Bond 31/01/2025       | 388 359          | 0,01              |
| 3 000 000 0.375% United States Treasury Note/ Bond 15/08/2024                | 2 840 508        | 0,11              | 1 250 000 4.125% United States Treasury Note/ Bond 31/01/2025     | 1 249 707        | 0,05              |
| 2 150 000 2.375% United States Treasury Note/ Bond 15/08/2024                | 2 092 723        | 0,08              | 3 000 000 1.500% United States Treasury Note/ Bond 15/02/2025     | 2 857 617        | 0,11              |
| 1 000 000 1.250% United States Treasury Note/ Bond 31/08/2024                | 957 422          | 0,04              | 1 900 000 2.000% United States Treasury Note/ Bond 15/02/2025     | 1 826 523        | 0,07              |
| 1 600 000 1.875% United States Treasury Note/ Bond 31/08/2024                | 1 545 500        | 0,06              | 1 200 000 1.125% United States Treasury Note/ Bond 28/02/2025     | 1 134 562        | 0,04              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 1 250 000 2.750% United States Treasury Note/ Bond 28/02/2025     | 1 218 896        | 0,05              | 2 800 000 4.250% United States Treasury Note/ Bond 15/10/2025     | 2 822 094        | 0,11              |
| 700 000 4.625% United States Treasury Note/ Bond 28/02/2025       | 706 809          | 0,03              | 2 200 000 0.250% United States Treasury Note/ Bond 31/10/2025     | 2 005 953        | 0,08              |
| 3 000 000 1.750% United States Treasury Note/ Bond 15/03/2025     | 2 869 453        | 0,11              | 400 000 3.000% United States Treasury Note/ Bond 31/10/2025       | 391 125          | 0,01              |
| 1 500 000 0.500% United States Treasury Note/ Bond 31/03/2025     | 1 399 043        | 0,05              | 1 900 000 4.000% United States Treasury Note/ Bond 15/11/2025     | 1 823 406        | 0,07              |
| 400 000 2.625% United States Treasury Note/ Bond 31/03/2025       | 389 234          | 0,01              | 2 500 000 4.500% United States Treasury Note/ Bond 15/11/2025     | 2 537 109        | 0,10              |
| 2 900 000 2.625% United States Treasury Note/ Bond 15/04/2025     | 2 818 211        | 0,11              | 2 500 000 0.375% United States Treasury Note/ Bond 30/11/2025     | 2 280 469        | 0,09              |
| 1 650 000 0.375% United States Treasury Note/ Bond 30/04/2025     | 1 530 375        | 0,06              | 600 000 2.875% United States Treasury Note/ Bond 30/11/2025       | 584 719          | 0,02              |
| 400 000 2.875% United States Treasury Note/ Bond 30/04/2025       | 390 531          | 0,01              | 2 500 000 4.000% United States Treasury Note/ Bond 15/12/2025     | 2 509 570        | 0,09              |
| 3 100 000 2.125% United States Treasury Note/ Bond 15/05/2025     | 2 980 359        | 0,11              | 2 000 000 0.375% United States Treasury Note/ Bond 31/12/2025     | 1 822 969        | 0,07              |
| 2 500 000 2.750% United States Treasury Note/ Bond 15/05/2025     | 2 434 766        | 0,09              | 500 000 2.625% United States Treasury Note/ Bond 31/12/2025       | 483 828          | 0,02              |
| 1 800 000 0.250% United States Treasury Note/ Bond 31/05/2025     | 1 661 062        | 0,06              | 2 500 000 3.875% United States Treasury Note/ Bond 15/01/2026     | 2 500 977        | 0,09              |
| 450 000 2.875% United States Treasury Note/ Bond 31/05/2025       | 439 277          | 0,02              | 3 250 000 0.375% United States Treasury Note/ Bond 31/01/2026     | 2 950 391        | 0,11              |
| 2 500 000 2.875% United States Treasury Note/ Bond 15/06/2025     | 2 441 211        | 0,09              | 900 000 2.625% United States Treasury Note/ Bond 31/01/2026       | 870 609          | 0,03              |
| 1 900 000 0.250% United States Treasury Note/ Bond 30/06/2025     | 1 751 266        | 0,07              | 1 400 000 1.625% United States Treasury Note/ Bond 15/02/2026     | 1 316 656        | 0,05              |
| 500 000 2.750% United States Treasury Note/ Bond 30/06/2025       | 486 563          | 0,02              | 3 000 000 0.500% United States Treasury Note/ Bond 28/02/2026     | 2 726 484        | 0,10              |
| 3 200 000 3.000% United States Treasury Note/ Bond 15/07/2025     | 3 131 500        | 0,12              | 1 050 000 2.500% United States Treasury Note/ Bond 28/02/2026     | 1 011 609        | 0,04              |
| 2 100 000 0.250% United States Treasury Note/ Bond 31/07/2025     | 1 928 391        | 0,07              | 2 500 000 0.750% United States Treasury Note/ Bond 31/03/2026     | 2 287 500        | 0,09              |
| 300 000 2.875% United States Treasury Note/ Bond 31/07/2025       | 292 945          | 0,01              | 750 000 2.250% United States Treasury Note/ Bond 31/03/2026       | 717 305          | 0,03              |
| 1 850 000 2.000% United States Treasury Note/ Bond 15/08/2025     | 1 770 219        | 0,07              | 2 500 000 0.750% United States Treasury Note/ Bond 30/04/2026     | 2 279 297        | 0,09              |
| 2 500 000 3.125% United States Treasury Note/ Bond 15/08/2025     | 2 453 125        | 0,09              | 1 000 000 2.375% United States Treasury Note/ Bond 30/04/2026     | 959 219          | 0,04              |
| 2 000 000 0.250% United States Treasury Note/ Bond 31/08/2025     | 1 832 187        | 0,07              | 1 850 000 1.625% United States Treasury Note/ Bond 15/05/2026     | 1 731 918        | 0,07              |
| 900 000 2.750% United States Treasury Note/ Bond 31/08/2025       | 875 180          | 0,03              | 2 500 000 0.750% United States Treasury Note/ Bond 31/05/2026     | 2 274 023        | 0,09              |
| 2 500 000 3.500% United States Treasury Note/ Bond 15/09/2025     | 2 476 172        | 0,09              | 1 600 000 2.125% United States Treasury Note/ Bond 31/05/2026     | 1 520 625        | 0,06              |
| 2 000 000 0.250% United States Treasury Note/ Bond 30/09/2025     | 1 830 312        | 0,07              | 2 500 000 0.875% United States Treasury Note/ Bond 30/06/2026     | 2 279 883        | 0,09              |
| 500 000 3.000% United States Treasury Note/ Bond 30/09/2025       | 488 984          | 0,02              | 1 100 000 1.875% United States Treasury Note/ Bond 30/06/2026     | 1 036 320        | 0,04              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 2 500 000 0.625% United States Treasury Note/<br>Bond 31/07/2026  | 2 255 078        | 0,08              | 1 400 000 0.500% United States Treasury Note/<br>Bond 30/06/2027  | 1 226 312        | 0,05              |
| 950 000 1.875% United States Treasury Note/<br>Bond 31/07/2026    | 893 668          | 0,03              | 2 500 000 3.250% United States Treasury Note/<br>Bond 30/06/2027  | 2 457 227        | 0,09              |
| 2 650 000 1.500% United States Treasury Note/<br>Bond 15/08/2026  | 2 460 152        | 0,09              | 1 400 000 0.375% United States Treasury Note/<br>Bond 31/07/2027  | 1 216 141        | 0,05              |
| 2 500 000 0.750% United States Treasury Note/<br>Bond 31/08/2026  | 2 259 766        | 0,08              | 2 500 000 2.750% United States Treasury Note/<br>Bond 31/07/2027  | 2 407 617        | 0,09              |
| 1 000 000 1.375% United States Treasury Note/<br>Bond 31/08/2026  | 923 281          | 0,03              | 1 550 000 2.250% United States Treasury Note/<br>Bond 15/08/2027  | 1 462 449        | 0,06              |
| 2 050 000 0.875% United States Treasury Note/<br>Bond 30/09/2026  | 1 857 012        | 0,07              | 1 500 000 0.500% United States Treasury Note/<br>Bond 31/08/2027  | 1 307 461        | 0,05              |
| 500 000 1.625% United States Treasury Note/<br>Bond 30/09/2026    | 465 430          | 0,02              | 1 500 000 3.125% United States Treasury Note/<br>Bond 31/08/2027  | 1 467 422        | 0,06              |
| 2 750 000 1.125% United States Treasury Note/<br>Bond 31/10/2026  | 2 508 730        | 0,09              | 1 550 000 0.375% United States Treasury Note/<br>Bond 30/09/2027  | 1 340 145        | 0,05              |
| 800 000 1.625% United States Treasury Note/<br>Bond 31/10/2026    | 743 375          | 0,03              | 2 500 000 4.125% United States Treasury Note/<br>Bond 30/09/2027  | 2 547 461        | 0,10              |
| 2 300 000 2.000% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2026  | 2 163 258        | 0,08              | 2 000 000 0.500% United States Treasury Note/<br>Bond 31/10/2027  | 1 735 625        | 0,07              |
| 2 750 000 1.250% United States Treasury Note/<br>Bond 30/11/2026  | 2 515 820        | 0,09              | 2 500 000 4.125% United States Treasury Note/<br>Bond 31/10/2027  | 2 548 437        | 0,10              |
| 900 000 6.000% United States Treasury Note/<br>Bond 30/11/2026    | 835 242          | 0,03              | 1 200 000 2.250% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2027  | 1 129 031        | 0,04              |
| 2 500 000 1.250% United States Treasury Note/<br>Bond 31/12/2026  | 2 283 984        | 0,09              | 2 300 000 0.625% United States Treasury Note/<br>Bond 30/11/2027  | 2 004 953        | 0,08              |
| 1 200 000 1.750% United States Treasury Note/<br>Bond 31/12/2026  | 1 117 500        | 0,04              | 2 500 000 3.875% United States Treasury Note/<br>Bond 30/11/2027  | 2 526 367        | 0,09              |
| 3 000 000 1.500% United States Treasury Note/<br>Bond 31/01/2027  | 2 762 109        | 0,10              | 2 400 000 0.625% United States Treasury Note/<br>Bond 31/12/2027  | 2 087 438        | 0,08              |
| 1 500 000 2.250% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2027  | 1 421 250        | 0,05              | 2 250 000 3.875% United States Treasury Note/<br>Bond 31/12/2027  | 2 273 906        | 0,09              |
| 400 000 1.125% United States Treasury Note/<br>Bond 28/02/2027    | 363 063          | 0,01              | 2 750 000 0.750% United States Treasury Note/<br>Bond 31/01/2028  | 2 402 168        | 0,09              |
| 2 500 000 1.875% United States Treasury Note/<br>Bond 28/02/2027  | 2 333 008        | 0,09              | 2 000 000 3.500% United States Treasury Note/<br>Bond 31/01/2028  | 1 989 844        | 0,07              |
| 1 000 000 0.625% United States Treasury Note/<br>Bond 31/03/2027  | 886 875          | 0,03              | 2 700 000 2.750% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2028  | 2 593 477        | 0,10              |
| 2 250 000 2.500% United States Treasury Note/<br>Bond 31/03/2027  | 2 149 102        | 0,08              | 2 800 000 1.125% United States Treasury Note/<br>Bond 29/02/2028  | 2 486 094        | 0,09              |
| 1 000 000 0.500% United States Treasury Note/<br>Bond 30/04/2027  | 880 625          | 0,03              | 2 400 000 1.250% United States Treasury Note/<br>Bond 31/03/2028  | 2 140 875        | 0,08              |
| 2 500 000 2.750% United States Treasury Note/<br>Bond 30/04/2027  | 2 409 570        | 0,09              | 3 250 000 1.250% United States Treasury Note/<br>Bond 30/04/2028  | 2 893 770        | 0,11              |
| 2 150 000 2.375% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2027  | 2 042 164        | 0,08              | 1 900 000 2.875% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2028  | 1 832 906        | 0,07              |
| 1 200 000 0.500% United States Treasury Note/<br>Bond 31/05/2027  | 1 053 094        | 0,04              | 2 800 000 1.250% United States Treasury Note/<br>Bond 31/05/2028  | 2 489 812        | 0,09              |
| 2 500 000 2.625% United States Treasury Note/<br>Bond 31/05/2027  | 2 397 266        | 0,09              | 2 500 000 1.250% United States Treasury Note/<br>Bond 30/06/2028  | 2 219 141        | 0,08              |



## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 3 250 000 1.000% United States Treasury Note/<br>Bond 31/07/2028  | 2 840 703        | 0,11              | 1 500 000 3.500% United States Treasury Note/<br>Bond 31/01/2030  | 1 492 734        | 0,06              |
| 2 150 000 2.875% United States Treasury Note/<br>Bond 15/08/2028  | 2 070 887        | 0,08              | 2 050 000 1.500% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2030  | 1 797 273        | 0,07              |
| 2 750 000 1.125% United States Treasury Note/<br>Bond 31/08/2028  | 2 415 059        | 0,09              | 3 000 000 4.000% United States Treasury Note/<br>Bond 28/02/2030  | 3 080 156        | 0,12              |
| 3 000 000 1.250% United States Treasury Note/<br>Bond 30/09/2028  | 2 647 031        | 0,10              | 1 500 000 3.625% United States Treasury Note/<br>Bond 31/03/2030  | 1 505 801        | 0,06              |
| 3 250 000 1.375% United States Treasury Note/<br>Bond 31/10/2028  | 2 883 867        | 0,11              | 2 700 000 0.625% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2030  | 2 210 203        | 0,08              |
| 2 050 000 3.125% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2028  | 1 998 430        | 0,08              | 3 600 000 0.625% United States Treasury Note/<br>Bond 15/08/2030  | 2 934 000        | 0,11              |
| 1 500 000 5.250% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2028  | 1 622 988        | 0,06              | 4 450 000 0.875% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2030  | 3 683 766        | 0,14              |
| 3 000 000 1.500% United States Treasury Note/<br>Bond 30/11/2028  | 2 676 328        | 0,10              | 3 950 000 1.125% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2031  | 3 326 023        | 0,13              |
| 2 500 000 1.375% United States Treasury Note/<br>Bond 31/12/2028  | 2 214 453        | 0,08              | 700 000 5.375% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2031    | 785 969          | 0,03              |
| 2 500 000 1.750% United States Treasury Note/<br>Bond 31/01/2029  | 2 257 227        | 0,08              | 4 050 000 1.625% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2031  | 3 520 336        | 0,13              |
| 1 850 000 2.625% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2029  | 1 754 320        | 0,07              | 5 000 000 1.250% United States Treasury Note/<br>Bond 15/08/2031  | 4 193 750        | 0,16              |
| 2 250 000 1.875% United States Treasury Note/<br>Bond 28/02/2029  | 2 044 160        | 0,08              | 4 900 000 1.375% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2031  | 4 135 906        | 0,16              |
| 2 500 000 2.375% United States Treasury Note/<br>Bond 31/03/2029  | 2 333 984        | 0,09              | 2 000 000 1.875% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2032  | 1 755 625        | 0,07              |
| 2 000 000 2.875% United States Treasury Note/<br>Bond 30/04/2029  | 1 920 312        | 0,07              | 4 600 000 2.875% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2032  | 4 377 906        | 0,16              |
| 1 600 000 2.375% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2029  | 1 492 875        | 0,06              | 4 250 000 2.750% United States Treasury Note/<br>Bond 15/08/2032  | 3 999 648        | 0,15              |
| 2 250 000 2.750% United States Treasury Note/<br>Bond 31/05/2029  | 2 144 531        | 0,08              | 4 000 000 4.125% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2032  | 4 203 281        | 0,16              |
| 1 750 000 3.250% United States Treasury Note/<br>Bond 30/06/2029  | 1 715 820        | 0,06              | 3 500 000 3.500% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2033  | 3 504 902        | 0,13              |
| 2 000 000 2.625% United States Treasury Note/<br>Bond 31/07/2029  | 1 891 562        | 0,07              | 600 000 4.500% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2036    | 666 563          | 0,03              |
| 1 100 000 1.625% United States Treasury Note/<br>Bond 15/08/2029  | 981 406          | 0,04              | 150 000 4.750% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2037    | 170 953          | 0,01              |
| 1 250 000 3.125% United States Treasury Note/<br>Bond 31/08/2029  | 1 216 895        | 0,05              | 1 000 000 5.000% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2037  | 1 165 820        | 0,04              |
| 2 250 000 3.875% United States Treasury Note/<br>Bond 30/09/2029  | 2 287 266        | 0,09              | 200 000 4.375% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2038    | 218 938          | 0,01              |
| 1 250 000 4.000% United States Treasury Note/<br>Bond 31/10/2029  | 1 280 273        | 0,05              | 500 000 4.500% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2038    | 554 063          | 0,02              |
| 900 000 1.750% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2029    | 808 313          | 0,03              | 200 000 3.500% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2039    | 197 594          | 0,01              |
| 1 500 000 3.875% United States Treasury Note/<br>Bond 30/11/2029  | 1 526 016        | 0,06              | 200 000 4.250% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2039    | 215 719          | 0,01              |
| 2 000 000 3.875% United States Treasury Note/<br>Bond 31/12/2029  | 2 036 250        | 0,08              | 800 000 4.500% United States Treasury Note/<br>Bond 15/08/2039    | 887 625          | 0,03              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 600 000 4.375% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2039    | 655 031          | 0,02              | 4 000 000 3.875% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2043  | 4 030 234        | 0,15              |
| 350 000 4.625% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2040    | 393 531          | 0,01              | 1 000 000 2.875% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2043  | 863 125          | 0,03              |
| 2 700 000 1.125% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2040  | 1 796 766        | 0,07              | 700 000 3.625% United States Treasury Note/<br>Bond 15/08/2043    | 679 109          | 0,03              |
| 250 000 4.375% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2040    | 272 617          | 0,01              | 500 000 3.750% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2043    | 493 516          | 0,02              |
| 3 100 000 1.125% United States Treasury Note/<br>Bond 15/08/2040  | 2 048 422        | 0,08              | 950 000 3.625% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2044    | 918 531          | 0,03              |
| 300 000 3.875% United States Treasury Note/<br>Bond 15/08/2040    | 307 453          | 0,01              | 575 000 3.375% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2044    | 534 660          | 0,02              |
| 3 300 000 1.375% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2040  | 2 270 812        | 0,09              | 600 000 3.125% United States Treasury Note/<br>Bond 15/08/2044    | 535 219          | 0,02              |
| 600 000 4.250% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2040    | 643 688          | 0,02              | 1 050 000 3.000% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2044  | 915 797          | 0,03              |
| 3 800 000 1.875% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2041  | 2 842 875        | 0,11              | 900 000 2.500% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2045    | 717 891          | 0,03              |
| 250 000 4.750% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2041    | 284 688          | 0,01              | 550 000 3.000% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2045    | 478 844          | 0,02              |
| 3 450 000 2.250% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2041  | 2 740 055        | 0,10              | 975 000 2.875% United States Treasury Note/<br>Bond 15/08/2045    | 830 578          | 0,03              |
| 200 000 4.375% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2041    | 217 531          | 0,01              | 600 000 3.000% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2045    | 521 906          | 0,02              |
| 4 200 000 1.750% United States Treasury Note/<br>Bond 15/08/2041  | 3 040 406        | 0,11              | 700 000 2.500% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2046    | 555 844          | 0,02              |
| 300 000 3.750% United States Treasury Note/<br>Bond 15/08/2041    | 299 391          | 0,01              | 925 000 2.500% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2046    | 734 074          | 0,03              |
| 3 700 000 2.000% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2041  | 2 791 187        | 0,10              | 1 010 000 2.250% United States Treasury Note/<br>Bond 15/08/2046  | 761 761          | 0,03              |
| 300 000 3.125% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2041    | 273 375          | 0,01              | 675 000 2.875% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2046    | 575 016          | 0,02              |
| 3 200 000 2.375% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2042  | 2 572 500        | 0,10              | 1 025 000 3.000% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2047  | 891 750          | 0,03              |
| 525 000 3.125% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2042    | 476 191          | 0,02              | 1 120 000 3.000% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2047  | 974 575          | 0,04              |
| 300 000 3.000% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2042    | 266 203          | 0,01              | 1 350 000 2.750% United States Treasury Note/<br>Bond 15/08/2047  | 1 122 188        | 0,04              |
| 2 950 000 3.250% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2042  | 2 721 836        | 0,10              | 1 350 000 2.750% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2047  | 1 123 242        | 0,04              |
| 300 000 2.750% United States Treasury Note/<br>Bond 15/08/2042    | 255 047          | 0,01              | 1 580 000 3.000% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2048  | 1 378 056        | 0,05              |
| 650 000 3.375% United States Treasury Note/<br>Bond 15/08/2042    | 610 492          | 0,02              | 1 675 000 3.125% United States Treasury Note/<br>Bond 15/05/2048  | 1 495 199        | 0,06              |
| 825 000 2.750% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2042    | 699 188          | 0,03              | 1 925 000 3.000% United States Treasury Note/<br>Bond 15/08/2048  | 1 680 465        | 0,06              |
| 2 350 000 4.000% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2042  | 2 413 891        | 0,09              | 1 825 000 3.375% United States Treasury Note/<br>Bond 15/11/2048  | 1 707 230        | 0,06              |
| 350 000 3.125% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2043    | 314 508          | 0,01              | 1 875 000 3.000% United States Treasury Note/<br>Bond 15/02/2049  | 1 641 211        | 0,06              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|--|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b>        |                    |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b>        |                    |                   |
| <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 30,26 % (suite)</b>                                |                    |                   |
| 2 100 000 2.875% United States Treasury Note/Bond 15/05/2049      | 1 796 484        | 0,07              | 300 000 3.664% Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C30 15/09/2058 | 287 001            | 0,01              |
| 1 770 000 2.250% United States Treasury Note/Bond 15/08/2049      | 1 330 542        | 0,05              |  | <b>805 596 536</b> | <b>30,26</b>      |
| 2 200 000 2.375% United States Treasury Note/Bond 15/11/2049      | 1 699 844        | 0,06              | <b>Yuan Renminbi – 8,45 %</b>  |                    |                   |
| 2 310 000 2.000% United States Treasury Note/Bond 15/02/2050      | 1 637 212        | 0,06              | 20 000 000 2.780% Agricultural Development Bank of China 21/07/2024      | 2 921 833          | 0,11              |
| 2 650 000 1.250% United States Treasury Note/Bond 15/05/2050      | 1 541 141        | 0,06              | 22 000 000 3.240% Agricultural Development Bank of China 14/08/2024      | 3 232 265          | 0,12              |
| 2 800 000 1.375% United States Treasury Note/Bond 15/08/2050      | 1 682 187        | 0,06              | 10 000 000 2.250% Agricultural Development Bank of China 22/04/2025      | 1 445 331          | 0,05              |
| 2 850 000 1.625% United States Treasury Note/Bond 15/11/2050      | 1 828 898        | 0,07              | 10 000 000 3.450% Agricultural Development Bank of China 23/09/2025      | 1 481 712          | 0,06              |
| 3 400 000 1.875% United States Treasury Note/Bond 15/02/2051      | 2 323 156        | 0,09              | 5 000 000 4.000% Agricultural Development Bank of China 12/11/2025       | 752 185            | 0,03              |
| 3 050 000 2.375% United States Treasury Note/Bond 15/05/2051      | 2 341 828        | 0,09              | 10 000 000 3.630% Agricultural Development Bank of China 19/07/2026      | 1 495 318          | 0,06              |
| 3 350 000 2.000% United States Treasury Note/Bond 15/08/2051      | 2 356 516        | 0,09              | 10 000 000 2.740% Agricultural Development Bank of China 23/02/2027      | 1 450 395          | 0,05              |
| 2 450 000 1.875% United States Treasury Note/Bond 15/11/2051      | 1 668 297        | 0,06              | 10 000 000 2.870% Agricultural Development Bank of China 14/05/2027      | 1 456 042          | 0,06              |
| 2 650 000 2.250% United States Treasury Note/Bond 15/02/2052      | 1 977 148        | 0,07              | 10 000 000 2.500% Agricultural Development Bank of China 24/08/2027      | 1 433 559          | 0,05              |
| 2 550 000 2.875% United States Treasury Note/Bond 15/05/2052      | 2 182 242        | 0,08              | 5 000 000 3.480% Agricultural Development Bank of China 04/02/2028       | 746 648            | 0,03              |
| 2 500 000 3.000% United States Treasury Note/Bond 15/08/2052      | 2 196 875        | 0,08              | 7 000 000 4.650% Agricultural Development Bank of China 11/05/2028       | 1 101 597          | 0,04              |
| 2 650 000 4.000% United States Treasury Note/Bond 15/11/2052      | 2 813 555        | 0,11              | 10 000 000 3.190% Agricultural Development Bank of China 12/08/2028      | 1 472 165          | 0,06              |
| 2 500 000 3.625% United States Treasury Note/Bond 15/02/2053      | 2 480 976        | 0,09              | 5 000 000 3.750% Agricultural Development Bank of China 25/01/2029       | 758 420            | 0,03              |
| 70 000 5.770% University of California 15/05/2043                 | 77 136           | 0,00              | 10 000 000 2.910% Agricultural Development Bank of China 21/02/2029      | 1 457 468          | 0,06              |
| 40 000 4.767% University of California 31/12/2099                 | 36 344           | 0,00              | 10 500 000 3.740% Agricultural Development Bank of China 12/07/2029      | 1 593 645          | 0,06              |
| 100 000 2.256% University of Virginia 01/09/2050                  | 64 312           | 0,00              | 10 000 000 2.830% Agricultural Development Bank of China 11/08/2029      | 1 440 369          | 0,05              |
| 33 333 4.500% Uruguay Government International Bond 14/08/2024    | 33 338           | 0,00              | 10 000 000 2.960% Agricultural Development Bank of China 17/04/2030      | 1 450 817          | 0,05              |
| 100 000 4.375% Uruguay Government International Bond 27/10/2027   | 100 440          | 0,00              | 10 000 000 3.790% Agricultural Development Bank of China 26/10/2030      | 1 529 763          | 0,06              |
| 50 000 4.375% Uruguay Government International Bond 23/01/2031    | 49 732           | 0,00              | 10 000 000 3.520% Agricultural Development Bank of China 24/05/2031      | 1 506 145          | 0,06              |
| 150 000 7.625% Uruguay Government International Bond 21/03/2036   | 188 310          | 0,01              | 5 000 000 3.300% Agricultural Development Bank of China 05/11/2031       | 742 515            | 0,03              |
| 50 000 5.100% Uruguay Government International Bond 18/06/2050    | 50 360           | 0,00              | 20 000 000 3.060% Agricultural Development Bank of China 06/06/2032      | 2 915 518          | 0,11              |
| 250 000 4.975% Uruguay Government International Bond 20/04/2055   | 246 108          | 0,01              | 5 000 000 2.970% Agricultural Development Bank of China 14/10/2032       | 722 753            | 0,03              |
|   |                  |                   | 3 000 000 3.920% Agricultural Development Bank of China 18/06/2051       | 483 363            | 0,02              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Yuan Renminbi – 8,45 % (suite)</b>                             |                  |                   | <b>Yuan Renminbi – 8,45 % (suite)</b>                             |                  |                   |
| 100 000 3.300% China Development Bank 01/02/2024                  | 14 661           | 0,00              | 10 000 000 3.000% China Development Bank 17/01/2032               | 1 451 079        | 0,05              |
| 13 000 000 3.420% China Development Bank 02/07/2024               | 1 914 042        | 0,07              | 10 000 000 2.980% China Development Bank 22/04/2032               | 1 448 940        | 0,05              |
| 20 000 000 3.230% China Development Bank 10/01/2025               | 2 944 535        | 0,11              | 20 000 000 2.960% China Development Bank 18/07/2032               | 2 894 534        | 0,11              |
| 10 000 000 2.590% China Development Bank 17/03/2025               | 1 456 420        | 0,06              | 10 000 000 2.770% China Development Bank 24/10/2032               | 1 422 499        | 0,05              |
| 3 000 000 4.730% China Development Bank 02/04/2025                | 454 528          | 0,02              | 8 300 000 3.800% China Development Bank 25/01/2036                | 1 290 333        | 0,05              |
| 5 000 000 2.890% China Development Bank 22/06/2025                | 731 848          | 0,03              | 2 000 000 3.900% China Development Bank 03/08/2040                | 315 784          | 0,01              |
| 25 000 000 3.340% China Development Bank 14/07/2025               | 3 696 275        | 0,14              | 3 000 000 3.490% China Development Bank 08/11/2041                | 450 158          | 0,02              |
| 5 500 000 3.680% China Development Bank 26/02/2026                | 822 593          | 0,03              | 7 000 000 2.840% China Government Bond 08/04/2024                 | 1 024 974        | 0,04              |
| 20 000 000 3.300% China Development Bank 03/03/2026               | 2 963 511        | 0,11              | 13 000 000 3.190% China Government Bond 11/04/2024                | 1 911 942        | 0,07              |
| 20 000 000 2.830% China Development Bank 10/09/2026               | 2 918 574        | 0,11              | 3 000 000 3.570% China Government Bond 22/06/2024                 | 444 138          | 0,02              |
| 20 000 000 3.430% China Development Bank 14/01/2027               | 2 973 668        | 0,11              | 30 000 000 2.180% China Government Bond 25/06/2024                | 4 358 171        | 0,16              |
| 20 000 000 2.650% China Development Bank 24/02/2027               | 2 894 854        | 0,11              | 15 000 000 2.470% China Government Bond 02/09/2024                | 2 186 354        | 0,08              |
| 24 000 000 2.690% China Development Bank 16/06/2027               | 3 475 850        | 0,13              | 22 000 000 2.940% China Government Bond 17/10/2024                | 3 231 401        | 0,12              |
| 8 000 000 4.880% China Development Bank 09/02/2028                | 1 268 107        | 0,05              | 10 000 000 2.290% China Government Bond 25/12/2024                | 1 453 422        | 0,05              |
| 6 000 000 4.040% China Development Bank 06/07/2028                | 920 756          | 0,03              | 20 000 000 2.260% China Government Bond 24/02/2025                | 2 902 042        | 0,11              |
| 17 000 000 3.480% China Development Bank 08/01/2029               | 2 541 570        | 0,10              | 3 000 000 3.770% China Government Bond 08/03/2025                 | 449 530          | 0,02              |
| 10 000 000 2.990% China Development Bank 01/03/2029               | 1 457 802        | 0,06              | 20 000 000 1.990% China Government Bond 09/04/2025                | 2 884 143        | 0,11              |
| 10 000 000 3.650% China Development Bank 21/05/2029               | 1 510 059        | 0,06              | 15 000 000 2.240% China Government Bond 25/05/2025                | 2 173 214        | 0,08              |
| 16 000 000 3.450% China Development Bank 20/09/2029               | 2 391 228        | 0,09              | 10 000 000 2.180% China Government Bond 25/08/2025                | 1 445 142        | 0,05              |
| 10 000 000 3.070% China Development Bank 10/03/2030               | 1 460 989        | 0,06              | 10 000 000 3.600% China Government Bond 06/09/2025                | 1 501 299        | 0,06              |
| 10 000 000 3.090% China Development Bank 18/06/2030               | 1 462 008        | 0,06              | 20 000 000 3.020% China Government Bond 22/10/2025                | 2 952 422        | 0,11              |
| 10 000 000 3.700% China Development Bank 20/10/2030               | 1 521 002        | 0,06              | 10 000 000 2.280% China Government Bond 25/11/2025                | 1 447 340        | 0,05              |
| 20 000 000 3.660% China Development Bank 01/03/2031               | 3 036 504        | 0,11              | 20 000 000 3.030% China Government Bond 11/03/2026                | 2 956 118        | 0,11              |
| 15 000 000 3.410% China Development Bank 07/06/2031               | 2 241 078        | 0,08              | 17 000 000 3.250% China Government Bond 06/06/2026                | 2 533 431        | 0,10              |
| 10 000 000 3.120% China Development Bank 13/09/2031               | 1 463 099        | 0,06              | 20 000 000 2.690% China Government Bond 12/08/2026                | 2 920 786        | 0,11              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Yuan Renminbi – 8,45 % (suite)</b>                             |                  |                   | <b>Yuan Renminbi – 8,45 % (suite)</b>                             |                  |                   |
| 16 000 000 3.120% China Government Bond 05/12/2026                | 2 374 348        | 0,09              | 12 750 000 3.740% China Government Bond 22/09/2035                | 2 021 695        | 0,08              |
| 20 000 000 2.370% China Government Bond 20/01/2027                | 2 885 220        | 0,11              | 1 500 000 4.270% China Government Bond 17/05/2037                 | 251 050          | 0,01              |
| 10 000 000 2.480% China Government Bond 15/04/2027                | 1 446 918        | 0,05              | 3 000 000 4.500% China Government Bond 23/06/2041                 | 523 785          | 0,02              |
| 10 000 000 2.850% China Government Bond 04/06/2027                | 1 466 461        | 0,06              | 2 000 000 4.760% China Government Bond 16/09/2043                 | 364 935          | 0,01              |
| 10 000 000 2.500% China Government Bond 25/07/2027                | 1 445 026        | 0,05              | 9 000 000 4.220% China Government Bond 19/03/2048                 | 1 533 150        | 0,06              |
| 20 000 000 2.440% China Government Bond 15/10/2027                | 2 883 852        | 0,11              | 15 000 000 3.970% China Government Bond 23/07/2048                | 2 457 635        | 0,09              |
| 10 000 000 3.280% China Government Bond 03/12/2027                | 1 498 941        | 0,06              | 15 000 000 4.080% China Government Bond 22/10/2048                | 2 497 406        | 0,09              |
| 22 000 000 3.010% China Government Bond 13/05/2028                | 3 250 962        | 0,12              | 12 600 000 3.860% China Government Bond 22/07/2049                | 2 028 971        | 0,08              |
| 3 000 000 3.540% China Government Bond 16/08/2028                 | 457 776          | 0,02              | 20 000 000 3.390% China Government Bond 16/03/2050                | 2 971 310        | 0,11              |
| 20 000 000 2.910% China Government Bond 14/10/2028                | 2 937 346        | 0,11              | 15 500 000 3.810% China Government Bond 14/09/2050                | 2 480 460        | 0,09              |
| 12 000 000 3.250% China Government Bond 22/11/2028                | 1 801 384        | 0,07              | 14 000 000 3.720% China Government Bond 12/04/2051                | 2 208 471        | 0,08              |
| 10 000 000 2.800% China Government Bond 24/03/2029                | 1 455 853        | 0,05              | 18 000 000 3.530% China Government Bond 18/10/2051                | 2 752 237        | 0,10              |
| 6 000 000 3.290% China Government Bond 23/05/2029                 | 904 883          | 0,03              | 18 000 000 3.320% China Government Bond 15/04/2052                | 2 663 545        | 0,10              |
| 20 000 000 2.750% China Government Bond 15/06/2029                | 2 900 383        | 0,11              | 18 000 000 3.120% China Government Bond 25/10/2052                | 2 564 873        | 0,10              |
| 10 000 000 2.620% China Government Bond 25/09/2029                | 1 437 400        | 0,05              | 25 000 000 2.930% Export-Import Bank of China 02/03/2025          | 3 659 713        | 0,14              |
| 10 000 000 2.790% China Government Bond 15/12/2029                | 1 452 331        | 0,05              | 10 000 000 2.570% Export-Import Bank of China 10/06/2025          | 1 454 121        | 0,05              |
| 15 000 000 2.680% China Government Bond 21/05/2030                | 2 158 829        | 0,08              | 5 000 000 3.430% Export-Import Bank of China 23/10/2025           | 740 798          | 0,03              |
| 12 000 000 3.270% China Government Bond 19/11/2030                | 1 809 067        | 0,07              | 20 000 000 3.220% Export-Import Bank of China 14/05/2026          | 2 954 372        | 0,11              |
| 20 000 000 3.020% China Government Bond 27/05/2031                | 2 951 898        | 0,11              | 10 000 000 2.610% Export-Import Bank of China 27/01/2027          | 1 445 098        | 0,05              |
| 15 000 000 2.750% China Government Bond 17/02/2032                | 2 162 125        | 0,08              | 6 000 000 3.260% Export-Import Bank of China 24/02/2027           | 887 106          | 0,03              |
| 8 000 000 2.760% China Government Bond 15/05/2032                 | 1 153 750        | 0,04              | 10 000 000 2.820% Export-Import Bank of China 17/06/2027          | 1 453 146        | 0,05              |
| 15 000 000 2.690% China Government Bond 15/08/2032                | 2 149 574        | 0,08              | 5 000 000 2.870% Export-Import Bank of China 06/02/2028           | 727 082          | 0,03              |
| 10 000 000 2.600% China Government Bond 01/09/2032                | 1 422 354        | 0,05              | 14 000 000 3.860% Export-Import Bank of China 20/05/2029          | 2 135 821        | 0,08              |
| 10 000 000 2.800% China Government Bond 15/11/2032                | 1 446 117        | 0,05              | 9 000 000 3.230% Export-Import Bank of China 23/03/2030           | 1 327 333        | 0,05              |
| 2 500 000 4.090% China Government Bond 27/04/2035                 | 409 293          | 0,02              | 10 000 000 3.380% Export-Import Bank of China 16/07/2031          | 1 491 389        | 0,06              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD     | % des actifs nets |
|---|----------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,66 % (mars 2022 : 97,92 %) (suite)</b> |                      |                   |
| <b>Obligations d'État – 74,20 % (mars 2022 : 73,82 %) (suite)</b> |                      |                   |
| <b>Yuan Renminbi – 8,45 % (suite)</b>                             |                      |                   |
| 10 000 000 3.180% Export-Import Bank of China<br>11/03/2032       | 1 469 706            | 0,06              |
| 10 000 000 2.900% Export-Import Bank of China<br>19/08/2032       | 1 437 415            | 0,05              |
|   | <b>224 939 297</b>   | <b>8,45</b>       |
| <b>Total des obligations d'État</b>                               | <b>1 975 533 611</b> | <b>74,20</b>      |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>                               | <b>2 600 003 423</b> | <b>97,66</b>      |

Instruments financiers dérivés – 1,60 % (mars 2022 : 1,53 %)

Contrats de change à terme – 0,34 % (mars 2022 : 0,52 %)^

| Devise achetée | Devise vendue | Montant acheté | Montant vendu | Date d'échéance | Contrepartie                | Plus-values/<br>(Moins-values)<br>latentes<br>USD | % du Comp. |
|----------------|---------------|----------------|---------------|-----------------|-----------------------------|---|------------|
| AUD            | CHF           | 16 915 000     | 10 368 895    | 05/04/2023      | HSBC Bank                   | (22 100)  | (0,00)     |
| AUD            | EUR           | 846 000        | 533 118       | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (12 609)  | (0,00)     |
| AUD            | EUR           | 9 852 000      | 6 064 262     | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | 9 743   | 0,00       |
| AUD            | EUR           | 31 000         | 19 112        | 04/05/2023      | Westpac Banking Corporation | (14)  | (0,00)     |
| AUD            | EUR           | 13 000         | 8 019         | 04/05/2023      | Barclays Bank               | (11)  | 0,00       |
| AUD            | EUR           | 55 000         | 33 775        | 04/05/2023      | Barclays Bank               | 120   | 0,00       |
| AUD            | GBP           | 907 000        | 492 052       | 05/04/2023      | HSBC Bank                   | (925)   | (0,00)     |
| AUD            | USD           | 20 312 000     | 13 600 916    | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | 3 544   | 0,00       |
| CAD            | CHF           | 29 289 000     | 19 784 719    | 05/04/2023      | HSBC Bank                   | (16 847)  | (0,00)     |
| CAD            | CHF           | 678 000        | 465 183       | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (8 265)   | (0,00)     |
| CAD            | EUR           | 2 395 000      | 1 649 286     | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (22 232)  | (0,00)     |
| CAD            | EUR           | 16 564 000     | 11 232 877    | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | 34 975  | 0,00       |
| CAD            | EUR           | 55 000         | 36 918        | 04/05/2023      | Westpac Banking Corporation | 481   | 0,00       |
| CAD            | EUR           | 528 000        | 356 941       | 04/05/2023      | Barclays Bank               | 1 869   | 0,00       |
| CAD            | GBP           | 62 000         | 37 606        | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (685)   | (0,00)     |
| CAD            | GBP           | 1 543 000      | 922 571       | 05/04/2023      | HSBC Bank                   | (571)   | (0,00)     |
| CAD            | USD           | 4 048 000      | 2 986 265     | 05/04/2023      | HSBC Bank                   | 4 914   | 0,00       |
| CAD            | USD           | 32 393 000     | 23 913 348    | 05/04/2023      | Barclays Bank               | 22 733  | 0,00       |
| CHF            | AUD           | 10 642 444     | 16 915 000    | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | 321 568   | 0,01       |
| CHF            | AUD           | 10 347 159     | 16 915 000    | 04/05/2023      | HSBC Bank                   | 21 855  | 0,00       |
| CHF            | CAD           | 20 674 863     | 29 967 000    | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | 490 338   | 0,02       |
| CHF            | CAD           | 19 731 121     | 29 289 000    | 04/05/2023      | HSBC Bank                   | 16 318  | 0,00       |
| CHF            | CNY           | 653 831        | 4 858 000     | 06/04/2023      | Westpac Banking Corporation | 8 793   | 0,00       |
| CHF            | CNY           | 64 587 634     | 479 544 000   | 06/04/2023      | UBS AG                      | 918 983   | 0,03       |
| CHF            | CNY           | 64 317 657     | 484 402 000   | 04/05/2023      | HSBC Bank                   | (36 381)  | (0,00)     |
| CHF            | COP           | 120 871        | 649 627 000   | 05/04/2023      | UBS AG                      | (7 082)   | (0,00)     |
| CHF            | COP           | 123 300        | 649 627 000   | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | (3 118)   | (0,00)     |
| CHF            | CZK           | 1 007 728      | 24 124 000    | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | (13 120)  | (0,00)     |
| CHF            | CZK           | 1 015 297      | 24 124 000    | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | 350   | 0,00       |
| CHF            | DKK           | 1 424 565      | 10 692 000    | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | 57  | 0,00       |
| CHF            | DKK           | 1 427 033      | 10 692 000    | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | 4 664   | 0,00       |
| CHF            | EUR           | 79 560 378     | 80 199 000    | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (38 310)  | (0,00)     |
| CHF            | EUR           | 79 112 632     | 79 743 000    | 05/04/2023      | UBS AG                      | (33 032)  | (0,00)     |
| CHF            | EUR           | 2 263 000      | 2 273 677     | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | 7 046   | 0,00       |
| CHF            | EUR           | 12 000         | 12 060        | 04/05/2023      | Barclays Bank               | 53  | 0,00       |
| CHF            | EUR           | 526 014        | 529 036       | 04/05/2023      | Westpac Banking Corporation | 1 910   | 0,00       |
| CHF            | EUR           | 78 619 433     | 79 117 000    | 04/05/2023      | Citibank                    | 235 650   | 0,01       |
| CHF            | EUR           | 78 629 797     | 79 117 000    | 04/05/2023      | Merrill Lynch International | 247 032   | 0,01       |
| CHF            | GBP           | 28 921 668     | 25 743 000    | 05/04/2023      | UBS AG                      | (168 627)   | (0,01)     |
| CHF            | GBP           | 179 000        | 158 533       | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | (63)  | (0,00)     |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

Instruments financiers dérivés – 1,60 % (mars 2022 : 1,53 %) (suite)

Contrats de change à terme – 0,34 % (mars 2022 : 0,52 %) (suite)

| Devise achetée | Devise vendue | Montant acheté | Montant vendu  | Date d'échéance | Contrepartie                | Plus-values/<br>(Moins-values)<br>latentes<br>USD | % du<br>Comp. |
|----------------|---------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------------------|---|---------------|
| CHF            | GBP           | 28 577 467     | 25 374 000     | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | (10 432)  | (0,00)        |
| CHF            | HKD           | 4 066          | 34 000         | 06/04/2023      | BNP Paribas                 | 120   | 0,00          |
| CHF            | HKD           | 3 958          | 34 000         | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | 8   | 0,00          |
| CHF            | HUF           | 473 230        | 183 691 000    | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | (6 455)   | (0,00)        |
| CHF            | HUF           | 473 199        | 183 691 000    | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | 140   | 0,00          |
| CHF            | IDR           | 3 363 233      | 55 389 080 000 | 05/04/2023      | HSBC Bank                   | (11 950)  | (0,00)        |
| CHF            | IDR           | 3 343 199      | 55 389 080 000 | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | (19 565)  | (0,00)        |
| CHF            | ILS           | 840 604        | 3 290 000      | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | 6 509   | 0,00          |
| CHF            | ILS           | 836 333        | 3 290 000      | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | 4 031   | 0,00          |
| CHF            | JPY           | 425 518        | 61 597 000     | 05/04/2023      | Royal Bank of Canada        | 2 948   | 0,00          |
| CHF            | JPY           | 1 306 503      | 189 682 000    | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | 4 873   | 0,00          |
| CHF            | JPY           | 43 845 893     | 6 347 017 500  | 05/04/2023      | HSBC Bank                   | 303 790   | 0,01          |
| CHF            | JPY           | 43 854 800     | 6 347 017 500  | 05/04/2023      | Goldman Sachs               | 313 541   | 0,01          |
| CHF            | JPY           | 44 718 984     | 6 472 657 000  | 08/05/2023      | BNP Paribas                 | 257 535   | 0,01          |
| CHF            | JPY           | 44 730 789     | 6 472 657 000  | 08/05/2023      | JP Morgan Chase Bank        | 270 505   | 0,01          |
| CHF            | KRW           | 7 704 061      | 10 849 740 000 | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | 99 460  | 0,00          |
| CHF            | KRW           | 7 742 017      | 10 849 740 000 | 04/05/2023      | UBS AG                      | 151 874   | 0,01          |
| CHF            | MXN           | 1 949 049      | 38 429 000     | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | 5 834   | 0,00          |
| CHF            | MXN           | 1 926 041      | 38 429 000     | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | (851)   | (0,00)        |
| CHF            | MYR           | 2 666 583      | 12 810 000     | 05/04/2023      | Goldman Sachs               | 15 935  | 0,00          |
| CHF            | MYR           | 2 651 076      | 12 810 000     | 08/05/2023      | Goldman Sachs               | 3 328   | 0,00          |
| CHF            | NOK           | 641 025        | 7 092 000      | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | 24 566  | 0,00          |
| CHF            | NOK           | 621 128        | 7 092 000      | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | 3 987   | 0,00          |
| CHF            | NZD           | 1 189 420      | 2 067 000      | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | 8 890   | 0,00          |
| CHF            | NZD           | 1 175 314      | 2 067 000      | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | (2 593)   | (0,00)        |
| CHF            | PEN           | 28 735         | 119 000        | 05/04/2023      | UBS AG                      | (180)   | (0,00)        |
| CHF            | PEN           | 28 714         | 119 000        | 04/05/2023      | UBS AG                      | (36)  | (0,00)        |
| CHF            | PLN           | 1 230 366      | 5 880 000      | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | (17 869)  | (0,00)        |
| CHF            | PLN           | 1 243 683      | 5 880 000      | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | 3 411   | 0,00          |
| CHF            | RON           | 247 872        | 1 234 000      | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | 380   | 0,00          |
| CHF            | RON           | 247 145        | 1 234 000      | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | 678   | 0,00          |
| CHF            | SEK           | 2 718 688      | 30 337 000     | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | 50 530  | 0,00          |
| CHF            | SEK           | 2 667 651      | 30 337 000     | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | (1 088)   | (0,00)        |
| CHF            | SGD           | 1 622 137      | 2 335 000      | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | 19 545  | 0,00          |
| CHF            | SGD           | 1 604 390      | 2 335 000      | 04/05/2023      | HSBC Bank                   | 3 974   | 0,00          |
| CHF            | THB           | 2 274 861      | 85 027 000     | 05/04/2023      | Citibank                    | 3 619   | 0,00          |
| CHF            | THB           | 2 287 714      | 85 027 000     | 08/05/2023      | Barclays Bank               | 17 754  | 0,00          |
| CHF            | USD           | 1 535 399      | 1 686 000      | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (5 123)   | (0,00)        |
| CHF            | USD           | 476 579        | 510 000        | 05/04/2023      | Goldman Sachs               | 11 734  | 0,00          |
| CHF            | USD           | 5 457 055      | 5 951 900      | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | 22 204  | 0,00          |
| CHF            | USD           | 116 294 626    | 124 116 666    | 05/04/2023      | Barclays Bank               | 3 196 734   | 0,12          |
| CHF            | USD           | 115 634 541    | 123 356 668    | 05/04/2023      | Citibank                    | 3 234 105   | 0,12          |
| CHF            | USD           | 116 834 171    | 124 634 666    | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | 3 269 401   | 0,12          |
| CHF            | USD           | 1 096 596      | 1 193 000      | 04/05/2023      | Westpac Banking Corporation | 11 242  | 0,00          |
| CHF            | USD           | 110 241 901    | 120 859 333    | 04/05/2023      | Barclays Bank               | 204 328   | 0,01          |
| CHF            | USD           | 110 302 271    | 120 859 334    | 04/05/2023      | JP Morgan Chase Bank        | 270 623   | 0,01          |
| CHF            | USD           | 110 313 752    | 120 859 333    | 04/05/2023      | Citibank                    | 283 232   | 0,01          |
| CLP            | EUR           | 2 976 000      | 3 394          | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | 77  | 0,00          |
| CLP            | USD           | 48 462 000     | 60 216         | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | 1 078   | 0,00          |
| CNH            | EUR           | 33 000         | 4 477          | 06/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (58)  | (0,00)        |
| CNH            | EUR           | 7 264 000      | 970 734        | 06/04/2023      | HSBC Bank                   | 3 168   | 0,00          |
| CNH            | EUR           | 911 000        | 122 842        | 04/05/2023      | Westpac Banking Corporation | (717)   | (0,00)        |
| CNH            | EUR           | 399 000        | 54 018         | 04/05/2023      | Barclays Bank               | (548)   | (0,00)        |
| CNH            | EUR           | 1 604 000      | 213 850        | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | 1 392   | 0,00          |
| CNY            | CHF           | 484 402 000    | 64 365 516     | 06/04/2023      | HSBC Bank                   | 31 271  | 0,00          |
| CNY            | EUR           | 35 013 000     | 4 735 296      | 06/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (49 208)  | (0,00)        |
| CNY            | EUR           | 3 382 000      | 461 516        | 06/04/2023      | Barclays Bank               | (9 231)   | (0,00)        |
| CNY            | EUR           | 260 094 000    | 34 766 348     | 06/04/2023      | Citibank                    | 79 722  | 0,00          |
| CNY            | EUR           | 6 738 000      | 908 185        | 04/05/2023      | Barclays Bank               | (5 375)   | (0,00)        |
| CNY            | EUR           | 5 301 000      | 713 646        | 04/05/2023      | Westpac Banking Corporation | (3 301)   | (0,00)        |
| CNY            | EUR           | 1 922 000      | 256 253        | 04/05/2023      | Barclays Bank               | 1 519   | 0,00          |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

Instruments financiers dérivés – 1,60 % (mars 2022 : 1,53 %) (suite)

Contrats de change à terme – 0,34 % (mars 2022 : 0,52 %) (suite)

| Devise<br>achetée | Devise<br>vendue | Montant<br>acheté | Montant<br>vendu | Date<br>d'échéance | Contrepartie                | Plus-values/<br>(Moins-values) latentes<br>USD | % du<br>Comp. |
|-------------------|------------------|-------------------|------------------|--------------------|-----------------------------|--|---------------|
| CNY               | GBP              | 641 000           | 76 476           | 06/04/2023         | Westpac Banking Corporation | (1 268)  | (0,00)        |
| CNY               | GBP              | 25 416 000        | 2 990 892        | 06/04/2023         | HSBC Bank                   | 965  | 0,00          |
| CNY               | GBP              | 151 000           | 17 763           | 04/05/2023         | Barclays Bank               | 53   | 0,00          |
| CNY               | USD              | 975 000           | 141 340          | 06/04/2023         | Westpac Banking Corporation | 599  | 0,00          |
| CNY               | USD              | 592 410 000       | 86 037 325       | 06/04/2023         | JP Morgan Chase Bank        | 187 824  | 0,01          |
| COP               | CHF              | 649 627 000       | 124 378          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 3 243  | 0,00          |
| COP               | EUR              | 1 029 513 000     | 198 076          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 5 714  | 0,00          |
| COP               | GBP              | 122 008 000       | 20 781           | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 487  | 0,00          |
| COP               | USD              | 2 773 075 000     | 580 977          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 14 105   | 0,00          |
| CZK               | CHF              | 24 124 000        | 1 020 307        | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (651)  | (0,00)        |
| CZK               | EUR              | 11 644 000        | 494 764          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 1 255  | 0,00          |
| CZK               | GBP              | 823 000           | 30 840           | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (49)   | (0,00)        |
| CZK               | USD              | 25 455 000        | 1 176 325        | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 1 596  | 0,00          |
| DKK               | CHF              | 10 692 000        | 1 428 809        | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (4 702)  | (0,00)        |
| DKK               | EUR              | 6 490 000         | 871 327          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (104)  | (0,00)        |
| DKK               | GBP              | 416 000           | 49 254           | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (225)  | (0,00)        |
| DKK               | USD              | 12 548 000        | 1 832 191        | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (1 999)  | (0,00)        |
| EUR               | AUD              | 45 070            | 73 000           | 05/04/2023         | Barclays Bank               | 75   | 0,00          |
| EUR               | AUD              | 109 918           | 172 000          | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | 4 226  | 0,00          |
| EUR               | AUD              | 6 636 206         | 10 453 000       | 05/04/2023         | UBS AG                      | 209 145  | 0,01          |
| EUR               | AUD              | 6 060 625         | 9 852 000        | 04/05/2023         | BNP Paribas                 | (9 833)  | (0,00)        |
| EUR               | AUD              | 20 393            | 33 000           | 04/05/2023         | Westpac Banking Corporation | 68   | 0,00          |
| EUR               | CAD              | 86 497            | 128 000          | 05/04/2023         | Barclays Bank               | (603)  | (0,00)        |
| EUR               | CAD              | 214 999           | 310 000          | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | 4 531  | 0,00          |
| EUR               | CAD              | 12 866 818        | 18 521 000       | 05/04/2023         | UBS AG                      | 294 236  | 0,01          |
| EUR               | CAD              | 11 219 030        | 16 564 000       | 04/05/2023         | BNP Paribas                 | (35 385)                                       | (0,00)        |
| EUR               | CAD              | 39 225            | 58 000           | 04/05/2023         | Westpac Banking Corporation | (189)  | (0,00)        |
| EUR               | CHF              | 79 117 000        | 78 745 150       | 05/04/2023         | Merrill Lynch International | (244 823)                                      | (0,01)        |
| EUR               | CHF              | 79 117 000        | 78 737 238       | 05/04/2023         | Citibank                    | (236 161)                                      | (0,01)        |
| EUR               | CHF              | 476 000           | 475 706          | 05/04/2023         | Deutsche Bank               | (3 600)  | (0,00)        |
| EUR               | CHF              | 16 097            | 16 000           | 05/04/2023         | Barclays Bank               | (27)   | (0,00)        |
| EUR               | CHF              | 1 269 580         | 1 259 464        | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | 613  | 0,00          |
| EUR               | CHF              | 2 229 385         | 2 210 000        | 05/04/2023         | Merrill Lynch International | 2 851  | 0,00          |
| EUR               | CHF              | 2 276 985         | 2 263 000        | 04/05/2023         | BNP Paribas                 | (7 151)  | (0,00)        |
| EUR               | CHF              | 7 029             | 7 000            | 04/05/2023         | Westpac Banking Corporation | (38)   | (0,00)        |
| EUR               | CLP              | 3 324             | 2 858 000        | 05/04/2023         | UBS AG                      | (3)  | 0,00          |
| EUR               | CLP              | 138               | 118 000          | 05/04/2023         | UBS AG                      | 1  | 0,00          |
| EUR               | CLP              | 3 377             | 2 976 000        | 04/05/2023         | Merrill Lynch International | (76)   | (0,00)        |
| EUR               | CNH              | 13 499            | 99 000           | 06/04/2023         | Westpac Banking Corporation | 249  | 0,00          |
| EUR               | CNH              | 154 486           | 1 126 000        | 06/04/2023         | BNP Paribas                 | 3 868  | 0,00          |
| EUR               | CNH              | 825 698           | 6 072 000        | 06/04/2023         | Morgan Stanley              | 12 845   | 0,00          |
| EUR               | CNH              | 971 422           | 7 264 000        | 04/05/2023         | HSBC Bank                   | (3 075)  | (0,00)        |
| EUR               | CNH              | 129 813           | 966 000          | 04/05/2023         | Westpac Banking Corporation | 275  | 0,00          |
| EUR               | CNY              | 40 542 240        | 298 489 000      | 06/04/2023         | BNP Paribas                 | 607 928  | 0,02          |
| EUR               | CNY              | 34 789 739        | 260 094 000      | 04/05/2023         | Citibank                    | (83 258)                                       | (0,00)        |
| EUR               | CNY              | 341 435           | 2 522 000        | 04/05/2023         | Barclays Bank               | 3 650  | 0,00          |
| EUR               | COP              | 189 529           | 1 003 966 000    | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (9 518)  | (0,00)        |
| EUR               | COP              | 4 928             | 25 547 000       | 05/04/2023         | UBS AG                      | (127)  | (0,00)        |
| EUR               | COP              | 196 639           | 1 029 513 000    | 04/05/2023         | BNP Paribas                 | (5 527)  | (0,00)        |
| EUR               | CZK              | 477 916           | 11 341 000       | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (5 540)  | (0,00)        |
| EUR               | CZK              | 8 325             | 198 000          | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | (117)  | (0,00)        |
| EUR               | CZK              | 4 405             | 105 000          | 05/04/2023         | Barclays Bank               | (72)   | (0,00)        |
| EUR               | CZK              | 493 173           | 11 644 000       | 04/05/2023         | BNP Paribas                 | (1 283)  | (0,00)        |
| EUR               | DKK              | 6 178             | 46 000           | 05/04/2023         | Barclays Bank               | 3  | 0,00          |
| EUR               | DKK              | 11 690            | 87 000           | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | 12   | 0,00          |
| EUR               | DKK              | 854 411           | 6 357 000        | 05/04/2023         | Merrill Lynch International | 1 124  | 0,00          |
| EUR               | DKK              | 871 526           | 6 490 000        | 04/05/2023         | BNP Paribas                 | 61   | 0,00          |
| EUR               | GBP              | 22 385 967        | 19 751 363       | 05/04/2023         | UBS AG                      | (99 521)                                       | (0,00)        |
| EUR               | GBP              | 4 258 493         | 3 749 987        | 05/04/2023         | Barclays Bank               | (9 876)  | (0,00)        |
| EUR               | GBP              | 241 318           | 213 000          | 05/04/2023         | Goldman Sachs               | (1 175)  | (0,00)        |
| EUR               | GBP              | 5 618             | 5 000            | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | (78)   | (0,00)        |



## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

Instruments financiers dérivés – 1,60 % (mars 2022 : 1,53 %) (suite)

Contrats de change à terme – 0,34 % (mars 2022 : 0,52 %) (suite)

| Devise achetée | Devise vendue | Montant acheté | Montant vendu  | Date d'échéance | Contrepartie                | Plus-values/ (Moins-values) latentes |  | % du Comp. |
|----------------|---------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------------------|--------------------------------------|--|------------|
|                |               |                |                |                 |                             | USD                                  |  |            |
| EUR            | GBP           | 401 058        | 351 788        | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | 775                                  |  | 0,00       |
| EUR            | GBP           | 16 300 163     | 14 352 000     | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | (17 430)                             |  | (0,00)     |
| EUR            | GBP           | 49 000         | 43 238         | 04/05/2023      | Barclays Bank               | (169)                                |  | (0,00)     |
| EUR            | GBP           | 56 821         | 50 000         | 04/05/2023      | Westpac Banking Corporation | (23)                                 |  | (0,00)     |
| EUR            | HKD           | 721            | 6 000          | 06/04/2023      | Westpac Banking Corporation | 19                                   |  | 0,00       |
| EUR            | HKD           | 1 448          | 12 000         | 06/04/2023      | Merrill Lynch International | 44                                   |  | 0,00       |
| EUR            | HKD           | 2 109          | 18 000         | 04/05/2023      | HSBC Bank                   | (2)                                  |  | 0,00       |
| EUR            | HUF           | 103 155        | 39 689 000     | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | (1 252)                              |  | (0,00)     |
| EUR            | HUF           | 3 921          | 1 513 000      | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (60)                                 |  | (0,00)     |
| EUR            | HUF           | 106 876        | 41 202 000     | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | (215)                                |  | (0,00)     |
| EUR            | IDR           | 14 844         | 245 020 000    | 05/04/2023      | Goldman Sachs               | (212)                                |  | (0,00)     |
| EUR            | IDR           | 6 819          | 111 574 000    | 05/04/2023      | HSBC Bank                   | (32)                                 |  | (0,00)     |
| EUR            | IDR           | 28 347         | 458 318 000    | 05/04/2023      | Goldman Sachs               | 235                                  |  | 0,00       |
| EUR            | IDR           | 2 071 647      | 33 643 677 000 | 05/04/2023      | HSBC Bank                   | 7 198                                |  | 0,00       |
| EUR            | IDR           | 2 090 934      | 34 458 589 000 | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | (20 687)                             |  | (0,00)     |
| EUR            | ILS           | 7 017          | 27 000         | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | 126                                  |  | 0,00       |
| EUR            | ILS           | 504 112        | 1 956 000      | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | 4 476                                |  | 0,00       |
| EUR            | ILS           | 507 047        | 1 983 000      | 04/05/2023      | HSBC Bank                   | 667                                  |  | 0,00       |
| EUR            | JPY           | 244 530        | 35 376 000     | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | (158)                                |  | (0,00)     |
| EUR            | JPY           | 18 381         | 2 663 000      | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (41)                                 |  | (0,00)     |
| EUR            | JPY           | 184 023        | 25 704 000     | 05/04/2023      | HSBC Bank                   | 6 782                                |  | 0,00       |
| EUR            | JPY           | 732 301        | 104 335 000    | 05/04/2023      | Goldman Sachs               | 11 597                               |  | 0,00       |
| EUR            | JPY           | 27 922 325     | 4 009 373 500  | 05/04/2023      | UBS AG                      | 208 294                              |  | 0,01       |
| EUR            | JPY           | 27 533 344     | 3 952 926 500  | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | 209 849                              |  | 0,01       |
| EUR            | JPY           | 24 929 730     | 3 583 702 000  | 08/05/2023      | Westpac Banking Corporation | 77 605                               |  | 0,00       |
| EUR            | JPY           | 25 241 849     | 3 625 140 000  | 08/05/2023      | Barclays Bank               | 104 474                              |  | 0,00       |
| EUR            | KRW           | 51 974         | 72 819 000     | 05/04/2023      | HSBC Bank                   | 533                                  |  | 0,00       |
| EUR            | KRW           | 69 154         | 95 098 000     | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | 2 084                                |  | 0,00       |
| EUR            | KRW           | 4 960 747      | 6 878 671 000  | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | 105 841                              |  | 0,00       |
| EUR            | KRW           | 16 240         | 22 826 000     | 04/05/2023      | Standard Chartered Bank     | 107                                  |  | 0,00       |
| EUR            | KRW           | 5 044 339      | 7 046 588 000  | 04/05/2023      | JP Morgan Chase Bank        | 66 484                               |  | 0,00       |
| EUR            | MXN           | 9 513          | 192 000        | 05/04/2023      | Barclays Bank               | (295)                                |  | (0,00)     |
| EUR            | MXN           | 22 723         | 449 000        | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (173)                                |  | (0,00)     |
| EUR            | MXN           | 1 184 481      | 23 152 000     | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | 4 980                                |  | 0,00       |
| EUR            | MXN           | 1 199 825      | 23 793 000     | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | (4 334)                              |  | (0,00)     |
| EUR            | MYR           | 11 660         | 56 000         | 05/04/2023      | Barclays Bank               | (23)                                 |  | (0,00)     |
| EUR            | MYR           | 22 278         | 105 000        | 05/04/2023      | Barclays Bank               | 408                                  |  | 0,00       |
| EUR            | MYR           | 1 261 988      | 5 974 000      | 05/04/2023      | Goldman Sachs               | 17 193                               |  | 0,00       |
| EUR            | MYR           | 1 278 525      | 6 135 000      | 08/05/2023      | Goldman Sachs               | (1 594)                              |  | (0,00)     |
| EUR            | NOK           | 5 400          | 59 000         | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | 234                                  |  | 0,00       |
| EUR            | NOK           | 369 732        | 4 055 000      | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | 14 517                               |  | 0,00       |
| EUR            | NOK           | 362 502        | 4 114 000      | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | 1 136                                |  | 0,00       |
| EUR            | NZD           | 4 580          | 8 000          | 05/04/2023      | Barclays Bank               | (29)                                 |  | (0,00)     |
| EUR            | NZD           | 9 371          | 16 000         | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | 171                                  |  | 0,00       |
| EUR            | NZD           | 712 791        | 1 228 000      | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | 6 152                                |  | 0,00       |
| EUR            | NZD           | 717 458        | 1 252 000      | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | (2 557)                              |  | (0,00)     |
| EUR            | PEN           | 2 967          | 12 000         | 05/04/2023      | UBS AG                      | 33                                   |  | 0,00       |
| EUR            | PEN           | 150 278        | 614 000        | 05/04/2023      | Barclays Bank               | 39                                   |  | 0,00       |
| EUR            | PEN           | 151 799        | 626 000        | 04/05/2023      | Barclays Bank               | (868)                                |  | (0,00)     |
| EUR            | PLN           | 738 184        | 3 496 000      | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | (9 415)                              |  | (0,00)     |
| EUR            | PLN           | 10 101         | 48 000         | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (167)                                |  | (0,00)     |
| EUR            | PLN           | 5 323          | 25 000         | 05/04/2023      | Barclays Bank               | (20)                                 |  | (0,00)     |
| EUR            | PLN           | 759 886        | 3 569 000      | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | 54                                   |  | 0,00       |
| EUR            | RON           | 4 251          | 21 000         | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | 8                                    |  | 0,00       |
| EUR            | RON           | 150 337        | 742 000        | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | 404                                  |  | 0,00       |
| EUR            | RON           | 153 764        | 763 000        | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | (58)                                 |  | (0,00)     |
| EUR            | SEK           | 11 754         | 131 000        | 05/04/2023      | Barclays Bank               | 137                                  |  | 0,00       |
| EUR            | SEK           | 28 067         | 311 000        | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | 501                                  |  | 0,00       |
| EUR            | SEK           | 1 630 790      | 18 040 000     | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | 32 061                               |  | 0,00       |
| EUR            | SEK           | 1 635 150      | 18 482 000     | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | (5 893)                              |  | (0,00)     |
| EUR            | SEK           | 5 350          | 60 000         | 04/05/2023      | Westpac Banking Corporation | 26                                   |  | 0,00       |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

Instruments financiers dérivés – 1,60 % (mars 2022 : 1,53 %) (suite)

Contrats de change à terme – 0,34 % (mars 2022 : 0,52 %) (suite)

| Devise<br>achetée | Devise<br>vendue | Montant<br>acheté | Montant<br>vendu | Date<br>d'échéance | Contrepartie                | Plus-values/<br>(Moins-values) latentes |        | % du<br>Comp. |
|-------------------|------------------|-------------------|------------------|--------------------|-----------------------------|---|--------|---------------|
|                   |                  |                   |                  |                    |                             | USD                                     |        |               |
| EUR               | SGD              | 6 240             | 9 000            | 05/04/2023         | Barclays Bank               | 11                                      | 0,00   |               |
| EUR               | SGD              | 13 331            | 19 000           | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | 193                                     | 0,00   |               |
| EUR               | SGD              | 780 729           | 1 114 000        | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 10 366                                  | 0,00   |               |
| EUR               | SGD              | 789 525           | 1 142 000        | 04/05/2023         | HSBC Bank                   | (533)                                   | (0,00) |               |
| EUR               | THB              | 10 069            | 373 000          | 05/04/2023         | Barclays Bank               | 31                                      | 0,00   |               |
| EUR               | THB              | 18 994            | 698 000          | 05/04/2023         | UBS AG                      | 223                                     | 0,00   |               |
| EUR               | THB              | 1 101 899         | 40 537 000       | 05/04/2023         | Citibank                    | 11 639                                  | 0,00   |               |
| EUR               | THB              | 1 125 440         | 41 608 000       | 08/05/2023         | Barclays Bank               | 3 843                                   | 0,00   |               |
| EUR               | USD              | 482 416           | 520 000          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 4 150                                   | 0,00   |               |
| EUR               | USD              | 96 820 999        | 105 188 395      | 05/04/2023         | Citibank                    | 8 493                                   | 0,00   |               |
| EUR               | USD              | 336 537           | 355 000          | 05/04/2023         | State Street Bank           | 10 650                                  | 0,00   |               |
| EUR               | USD              | 1 430 301         | 1 526 667        | 05/04/2023         | Royal Bank of Canada        | 27 368                                  | 0,00   |               |
| EUR               | USD              | 98 011 998        | 106 462 684      | 05/04/2023         | Merrill Lynch International | 28 236                                  | 0,00   |               |
| EUR               | USD              | 1 663 972         | 1 778 704        | 05/04/2023         | Barclays Bank               | 29 215                                  | 0,00   |               |
| EUR               | USD              | 71 522 156        | 75 642 333       | 05/04/2023         | Goldman Sachs               | 2 067 135                               | 0,08   |               |
| EUR               | USD              | 71 535 752        | 75 642 333       | 05/04/2023         | HSBC Bank                   | 2 081 907                               | 0,08   |               |
| EUR               | USD              | 73 163 682        | 77 364 307       | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | 2 128 694                               | 0,08   |               |
| EUR               | USD              | 60 403 183        | 65 735 999       | 04/05/2023         | Merrill Lynch International | (489)                                   | (0,00) |               |
| EUR               | USD              | 328 852           | 357 000          | 04/05/2023         | BNP Paribas                 | 883                                     | 0,00   |               |
| EUR               | USD              | 60 407 612        | 65 735 999       | 04/05/2023         | Citibank                    | 4 332                                   | 0,00   |               |
| EUR               | USD              | 60 737 763        | 66 093 002       | 04/05/2023         | Westpac Banking Corporation | 6 624                                   | 0,00   |               |
| EUR               | USD              | 1 728 967         | 1 865 000        | 04/05/2023         | Barclays Bank               | 16 598                                  | 0,00   |               |
| GBP               | AUD              | 64 216            | 115 000          | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | 2 377                                   | 0,00   |               |
| GBP               | AUD              | 444 332           | 792 000          | 05/04/2023         | Merrill Lynch International | 18 945                                  | 0,00   |               |
| GBP               | AUD              | 492 271           | 907 000          | 04/05/2023         | HSBC Bank                   | 930                                     | 0,00   |               |
| GBP               | CAD              | 123 089           | 201 000          | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | 3 673                                   | 0,00   |               |
| GBP               | CAD              | 861 601           | 1 404 000        | 05/04/2023         | Merrill Lynch International | 27 894                                  | 0,00   |               |
| GBP               | CAD              | 922 416           | 1 543 000        | 04/05/2023         | HSBC Bank                   | 578                                     | 0,00   |               |
| GBP               | CHF              | 369 000           | 417 394          | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | (683)                                   | (0,00) |               |
| GBP               | CHF              | 22 510            | 25 000           | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | 464                                     | 0,00   |               |
| GBP               | CHF              | 137 051           | 154 000          | 05/04/2023         | Merrill Lynch International | 869                                     | 0,00   |               |
| GBP               | CHF              | 25 374 000        | 28 649 783       | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 10 013                                  | 0,00   |               |
| GBP               | CHF              | 158 935           | 179 000          | 04/05/2023         | BNP Paribas                 | 65                                      | 0,00   |               |
| GBP               | CNY              | 428 349           | 3 528 000        | 06/04/2023         | Westpac Banking Corporation | 16 166                                  | 0,00   |               |
| GBP               | CNY              | 2 700 752         | 22 529 000       | 06/04/2023         | Merrill Lynch International | 60 469                                  | 0,00   |               |
| GBP               | CNY              | 2 996 110         | 25 416 000       | 04/05/2023         | HSBC Bank                   | (1 009)                                 | (0,00) |               |
| GBP               | CNY              | 20 013            | 168 000          | 04/05/2023         | Westpac Banking Corporation | 252                                     | 0,00   |               |
| GBP               | CNY              | 47 851            | 401 000          | 04/05/2023         | Barclays Bank               | 701                                     | 0,00   |               |
| GBP               | COP              | 20 309            | 122 008 000      | 05/04/2023         | Barclays Bank               | (1 071)                                 | (0,00) |               |
| GBP               | COP              | 20 651            | 122 008 000      | 04/05/2023         | BNP Paribas                 | (467)                                   | (0,00) |               |
| GBP               | CZK              | 30 597            | 823 000          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (252)                                   | (0,00) |               |
| GBP               | CZK              | 30 774            | 823 000          | 04/05/2023         | BNP Paribas                 | 48                                      | 0,00   |               |
| GBP               | DKK              | 49 327            | 416 000          | 05/04/2023         | Merrill Lynch International | 316                                     | 0,00   |               |
| GBP               | DKK              | 49 318            | 416 000          | 04/05/2023         | BNP Paribas                 | 225                                     | 0,00   |               |
| GBP               | EUR              | 899 020           | 1 024 840        | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | (1 881)                                 | (0,00) |               |
| GBP               | EUR              | 14 381 125        | 16 350 620       | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 16 812                                  | 0,00   |               |
| GBP               | EUR              | 3 293 967         | 3 731 500        | 05/04/2023         | Barclays Bank               | 18 601                                  | 0,00   |               |
| GBP               | EUR              | 3 298 736         | 3 731 500        | 05/04/2023         | Citibank                    | 24 497                                  | 0,00   |               |
| GBP               | EUR              | 2 235 727         | 2 511 385        | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | 35 779                                  | 0,00   |               |
| GBP               | EUR              | 351 000           | 399 046          | 04/05/2023         | Barclays Bank               | (10)                                    | 0,00   |               |
| GBP               | EUR              | 94 711            | 107 108          | 04/05/2023         | Westpac Banking Corporation | 615                                     | 0,00   |               |
| GBP               | EUR              | 3 641 488         | 4 134 000        | 04/05/2023         | UBS AG                      | 6 369                                   | 0,00   |               |
| GBP               | EUR              | 3 861 465         | 4 380 752        | 04/05/2023         | Barclays Bank               | 9 995                                   | 0,00   |               |
| GBP               | HUF              | 20 095            | 8 764 000        | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (178)                                   | (0,00) |               |
| GBP               | HUF              | 20 053            | 8 764 000        | 04/05/2023         | BNP Paribas                 | 24                                      | 0,00   |               |
| GBP               | IDR              | 135 897           | 2 499 559 000    | 05/04/2023         | HSBC Bank                   | 1 340                                   | 0,00   |               |
| GBP               | IDR              | 134 369           | 2 499 559 000    | 04/05/2023         | BNP Paribas                 | (318)                                   | (0,00) |               |
| GBP               | ILS              | 27 058            | 119 000          | 05/04/2023         | Merrill Lynch International | 406                                     | 0,00   |               |
| GBP               | ILS              | 26 865            | 119 000          | 04/05/2023         | HSBC Bank                   | 164                                     | 0,00   |               |
| GBP               | JPY              | 16 397            | 2 647 000        | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 383                                     | 0,00   |               |
| GBP               | JPY              | 581 171           | 93 982 000       | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | 12 350                                  | 0,00   |               |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

Instruments financiers dérivés – 1,60 % (mars 2022 : 1,53 %) (suite)

Contrats de change à terme – 0,34 % (mars 2022 : 0,52 %) (suite)

| Devise<br>achetée | Devise<br>vendue | Montant<br>acheté | Montant<br>vendu | Date<br>d'échéance | Contrepartie                | Plus-values/<br>(Moins-values) latentes<br>USD | % du<br>Comp. |
|-------------------|------------------|-------------------|------------------|--------------------|-----------------------------|--|---------------|
| GBP               | JPY              | 1 834 332         | 298 154 000      | 05/04/2023         | UBS AG                      | 27 545   | 0,00          |
| GBP               | JPY              | 1 834 639         | 298 154 000      | 05/04/2023         | Royal Bank of Canada        | 27 924   | 0,00          |
| GBP               | JPY              | 67 386            | 10 707 000       | 09/05/2023         | Barclays Bank               | 2 523  | 0,00          |
| GBP               | JPY              | 2 072 187         | 338 052 500      | 09/05/2023         | BNP Paribas                 | 11 130   | 0,00          |
| GBP               | JPY              | 2 100 035         | 342 550 500      | 09/05/2023         | Westpac Banking Corporation | 11 621   | 0,00          |
| GBP               | KRW              | 50 515            | 78 608 000       | 05/04/2023         | HSBC Bank                   | 2 076  | 0,00          |
| GBP               | KRW              | 331 462           | 521 987 000      | 05/04/2023         | Barclays Bank               | 8 865  | 0,00          |
| GBP               | KRW              | 380 798           | 600 595 000      | 04/05/2023         | Merrill Lynch International | 8 903  | 0,00          |
| GBP               | MXN              | 80 792            | 1 790 000        | 05/04/2023         | Merrill Lynch International | 781  | 0,00          |
| GBP               | MXN              | 79 688            | 1 790 000        | 04/05/2023         | BNP Paribas                 | 32   | 0,00          |
| GBP               | MYR              | 107 816           | 578 000          | 05/04/2023         | Goldman Sachs               | 2 311  | 0,00          |
| GBP               | MYR              | 106 819           | 578 000          | 09/05/2023         | Goldman Sachs               | 895  | 0,00          |
| GBP               | NOK              | 20 914            | 260 000          | 05/04/2023         | Merrill Lynch International | 1 033  | 0,00          |
| GBP               | NOK              | 20 226            | 260 000          | 04/05/2023         | BNP Paribas                 | 164  | 0,00          |
| GBP               | NZD              | 39 943            | 78 000           | 05/04/2023         | Merrill Lynch International | 587  | 0,00          |
| GBP               | NZD              | 39 399            | 78 000           | 04/05/2023         | HSBC Bank                   | (58)   | (0,00)        |
| GBP               | PEN              | 11 445            | 53 000           | 05/04/2023         | Barclays Bank               | 61   | 0,00          |
| GBP               | PEN              | 11 387            | 53 000           | 04/05/2023         | Barclays Bank               | 28   | 0,00          |
| GBP               | PLN              | 43 392            | 233 000          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (429)  | (0,00)        |
| GBP               | PLN              | 43 782            | 233 000          | 04/05/2023         | HSBC Bank                   | 183  | 0,00          |
| GBP               | RON              | 18 590            | 104 000          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 148  | 0,00          |
| GBP               | RON              | 18 503            | 104 000          | 04/05/2023         | HSBC Bank                   | 76   | 0,00          |
| GBP               | SEK              | 16 395            | 207 000          | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | 308  | 0,00          |
| GBP               | SEK              | 97 538            | 1 223 000        | 05/04/2023         | Merrill Lynch International | 2 655  | 0,00          |
| GBP               | SEK              | 111 714           | 1 430 000        | 04/05/2023         | HSBC Bank                   | 74   | 0,00          |
| GBP               | SGD              | 51 317            | 83 000           | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 1 023  | 0,00          |
| GBP               | SGD              | 50 662            | 83 000           | 04/05/2023         | HSBC Bank                   | 194  | 0,00          |
| GBP               | THB              | 83 882            | 3 498 000        | 05/04/2023         | Citibank                    | 1 413  | 0,00          |
| GBP               | THB              | 83 745            | 3 498 000        | 09/05/2023         | Barclays Bank               | 942  | 0,00          |
| GBP               | USD              | 1 101 674         | 1 306 000        | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 56 192   | 0,00          |
| GBP               | USD              | 31 968 179        | 39 436 233       | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | 91 635   | 0,00          |
| GBP               | USD              | 4 800 982         | 5 743 333        | 05/04/2023         | HSBC Bank                   | 192 963  | 0,01          |
| GBP               | USD              | 4 803 174         | 5 743 333        | 05/04/2023         | Barclays Bank               | 195 674  | 0,01          |
| GBP               | USD              | 5 839 599         | 6 973 334        | 05/04/2023         | Royal Bank of Canada        | 247 187  | 0,01          |
| GBP               | USD              | 5 077 869         | 6 274 002        | 04/05/2023         | UBS AG                      | 8 430  | 0,00          |
| GBP               | USD              | 5 320 368         | 6 570 999        | 04/05/2023         | Barclays Bank               | 11 456   | 0,00          |
| GBP               | USD              | 5 181 394         | 6 397 999        | 04/05/2023         | Westpac Banking Corporation | 12 514   | 0,00          |
| HKD               | CHF              | 34 000            | 3 964            | 06/04/2023         | BNP Paribas                 | (9)  | 0,00          |
| HKD               | EUR              | 18 000            | 2 109            | 06/04/2023         | HSBC Bank                   | 2  | 0,00          |
| HKD               | USD              | 213 000           | 27 140           | 06/04/2023         | HSBC Bank                   | (3)  | 0,00          |
| HUF               | CHF              | 183 691 000       | 479 374          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (270)  | (0,00)        |
| HUF               | EUR              | 41 202 000        | 108 090          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 210  | 0,00          |
| HUF               | GBP              | 8 764 000         | 20 260           | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (25)   | (0,00)        |
| HUF               | USD              | 174 702 000       | 498 249          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 608  | 0,00          |
| IDR               | CHF              | 55 389 080 000    | 3 357 176        | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 18 581   | 0,00          |
| IDR               | EUR              | 34 458 589 000    | 2 095 256        | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 21 496   | 0,00          |
| IDR               | EUR              | 185 511 000       | 11 296           | 04/05/2023         | HSBC Bank                   | 69   | 0,00          |
| IDR               | GBP              | 2 499 559 000     | 134 506          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 379  | 0,00          |
| IDR               | USD              | 66 629 786 000    | 4 409 736        | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 33 935   | 0,00          |
| ILS               | CHF              | 3 290 000         | 838 472          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (4 175)  | (0,00)        |
| ILS               | EUR              | 1 983 000         | 507 506          | 05/04/2023         | HSBC Bank                   | (666)  | (0,00)        |
| ILS               | GBP              | 119 000           | 26 860           | 05/04/2023         | HSBC Bank                   | (162)  | (0,00)        |
| ILS               | USD              | 4 940 000         | 1 375 130        | 05/04/2023         | HSBC Bank                   | (3 130)  | (0,00)        |
| JPY               | CHF              | 6 472 657 000     | 44 675 987       | 05/04/2023         | JP Morgan Chase Bank        | (268 381)                                      | (0,01)        |
| JPY               | CHF              | 6 472 657 000     | 44 664 827       | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (256 163)                                      | (0,01)        |
| JPY               | EUR              | 3 648 030 000     | 25 315 761       | 05/04/2023         | Barclays Bank               | (91 657)                                       | (0,00)        |
| JPY               | EUR              | 3 748 040 000     | 26 002 249       | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | (85 978)                                       | (0,00)        |
| JPY               | EUR              | 734 308 000       | 5 070 080        | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | 9 475  | 0,00          |
| JPY               | EUR              | 190 117 000       | 1 346 303        | 08/05/2023         | Barclays Bank               | (29 992)                                       | (0,00)        |
| JPY               | EUR              | 165 499 000       | 1 165 103        | 08/05/2023         | Westpac Banking Corporation | (18 631)                                       | (0,00)        |
| JPY               | EUR              | 42 737 000        | 295 941          | 08/05/2023         | Royal Bank of Canada        | 550  | 0,00          |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

Instruments financiers dérivés – 1,60 % (mars 2022 : 1,53 %) (suite)

Contrats de change à terme – 0,34 % (mars 2022 : 0,52 %) (suite)

| Devise<br>achetée | Devise<br>vendue | Montant<br>acheté | Montant<br>vendu | Date<br>d'échéance | Contrepartie                | Plus-values/<br>(Moins-values) latentes<br>USD | % du<br>Comp. |
|-------------------|------------------|-------------------|------------------|--------------------|-----------------------------|--|---------------|
| JPY               | EUR              | 51 214 000        | 354 643          | 08/05/2023         | Barclays Bank               | 658  | 0,00          |
| JPY               | GBP              | 354 884 500       | 2 167 190        | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | (12 798)                                       | (0,00)        |
| JPY               | GBP              | 338 052 500       | 2 063 435        | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (10 996)                                       | (0,00)        |
| JPY               | GBP              | 4 025 000         | 24 600           | 09/05/2023         | Barclays Bank               | (43)   | (0,00)        |
| JPY               | USD              | 7 913 318 000     | 59 628 649       | 05/04/2023         | HSBC Bank                   | (161 795)                                      | (0,01)        |
| JPY               | USD              | 7 939 304 999     | 59 797 978       | 05/04/2023         | Westpac Banking Corporation | (135 836)                                      | (0,01)        |
| KRW               | CHF              | 10 849 740 000    | 7 751 863        | 05/04/2023         | UBS AG                      | (151 792)                                      | (0,01)        |
| KRW               | EUR              | 7 046 588 000     | 5 044 086        | 05/04/2023         | JP Morgan Chase Bank        | (67 398)                                       | (0,00)        |
| KRW               | EUR              | 21 512 000        | 15 453           | 04/05/2023         | UBS AG                      | (262)  | (0,00)        |
| KRW               | EUR              | 37 882 000        | 26 765           | 04/05/2023         | HSBC Bank                   | 27   | 0,00          |
| KRW               | GBP              | 600 595 000       | 380 364          | 05/04/2023         | Merrill Lynch International | (8 946)  | (0,00)        |
| KRW               | USD              | 13 710 767 000    | 10 678 999       | 05/04/2023         | JP Morgan Chase Bank        | (146 931)                                      | (0,01)        |
| MXN               | CHF              | 38 429 000        | 1 943 446        | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 300  | 0,00          |
| MXN               | EUR              | 23 793 000        | 1 208 864        | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 4 021  | 0,00          |
| MXN               | EUR              | 145 000           | 7 273            | 04/05/2023         | Barclays Bank               | 69   | 0,00          |
| MXN               | GBP              | 1 790 000         | 80 202           | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (52)   | (0,00)        |
| MXN               | USD              | 56 413 000        | 3 117 204        | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 6 488  | 0,00          |
| MYR               | CHF              | 12 810 000        | 2 658 780        | 05/04/2023         | Goldman Sachs               | (7 392)  | (0,00)        |
| MYR               | EUR              | 6 135 000         | 1 278 125        | 05/04/2023         | Goldman Sachs               | 1 764  | 0,00          |
| MYR               | GBP              | 578 000           | 106 642          | 05/04/2023         | Goldman Sachs               | (860)  | (0,00)        |
| MYR               | USD              | 13 832 000        | 3 132 247        | 05/04/2023         | Goldman Sachs               | 2 757  | 0,00          |
| NOK               | CHF              | 7 092 000         | 622 249          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (4 012)  | (0,00)        |
| NOK               | EUR              | 4 114 000         | 362 625          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (1 161)  | (0,00)        |
| NOK               | GBP              | 260 000           | 20 211           | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (164)  | (0,00)        |
| NOK               | USD              | 6 198 000         | 594 190          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (2 361)  | (0,00)        |
| NZD               | CHF              | 2 067 000         | 1 178 994        | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 2 524  | 0,00          |
| NZD               | EUR              | 1 252 000         | 718 603          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 2 550  | 0,00          |
| NZD               | GBP              | 78 000            | 39 421           | 05/04/2023         | HSBC Bank                   | 58   | 0,00          |
| NZD               | USD              | 2 365 000         | 1 475 760        | 05/04/2023         | HSBC Bank                   | 3 910  | 0,00          |
| PEN               | CHF              | 119 000           | 28 877           | 05/04/2023         | UBS AG                      | 25   | 0,00          |
| PEN               | EUR              | 626 000           | 152 391          | 05/04/2023         | Barclays Bank               | 856  | 0,00          |
| PEN               | GBP              | 53 000            | 11 419           | 05/04/2023         | Barclays Bank               | (28)   | (0,00)        |
| PEN               | USD              | 1 704 000         | 452 374          | 05/04/2023         | Standard Chartered Bank     | 657  | 0,00          |
| PLN               | CHF              | 5 880 000         | 1 250 094        | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (3 728)  | (0,00)        |
| PLN               | EUR              | 3 569 000         | 762 511          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (72)   | (0,00)        |
| PLN               | GBP              | 233 000           | 43 886           | 05/04/2023         | HSBC Bank                   | (182)  | (0,00)        |
| PLN               | USD              | 8 049 000         | 1 869 698        | 05/04/2023         | HSBC Bank                   | (1 439)  | (0,00)        |
| RON               | CHF              | 1 234 000         | 248 214          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (753)  | (0,00)        |
| RON               | EUR              | 763 000           | 154 168          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 44   | 0,00          |
| RON               | GBP              | 104 000           | 18 532           | 05/04/2023         | HSBC Bank                   | (76)   | (0,00)        |
| RON               | USD              | 2 052 000         | 450 936          | 05/04/2023         | HSBC Bank                   | (330)  | (0,00)        |
| SEK               | CHF              | 30 337 000        | 2 671 564        | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 1 058  | 0,00          |
| SEK               | EUR              | 18 482 000        | 1 635 161        | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 5 817  | 0,00          |
| SEK               | EUR              | 99 000            | 8 758            | 04/05/2023         | Barclays Bank               | 33   | 0,00          |
| SEK               | GBP              | 1 430 000         | 111 595          | 05/04/2023         | HSBC Bank                   | (73)   | (0,00)        |
| SEK               | USD              | 39 647 000        | 3 814 860        | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 8 761  | 0,00          |
| SGD               | CHF              | 2 335 000         | 1 608 061        | 05/04/2023         | HSBC Bank                   | (4 136)  | (0,00)        |
| SGD               | EUR              | 1 142 000         | 790 169          | 05/04/2023         | HSBC Bank                   | 438  | 0,00          |
| SGD               | GBP              | 83 000            | 50 649           | 05/04/2023         | HSBC Bank                   | (198)  | (0,00)        |
| SGD               | USD              | 2 630 000         | 1 979 288        | 05/04/2023         | HSBC Bank                   | (1 115)  | (0,00)        |
| THB               | CHF              | 85 027 000        | 2 287 714        | 05/04/2023         | Barclays Bank               | (17 689)                                       | (0,00)        |
| THB               | EUR              | 41 608 000        | 1 123 554        | 05/04/2023         | Barclays Bank               | (3 843)  | (0,00)        |
| THB               | GBP              | 3 498 000         | 83 496           | 05/04/2023         | Barclays Bank               | (935)  | (0,00)        |
| THB               | USD              | 102 598 000       | 3 014 361        | 05/04/2023         | Barclays Bank               | (13 680)                                       | (0,00)        |
| USD               | AUD              | 61 349            | 90 000           | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | 1 069  | 0,00          |
| USD               | AUD              | 13 591 732        | 20 222 000       | 05/04/2023         | Royal Bank of Canada        | 47 553   | 0,00          |
| USD               | AUD              | 13 615 032        | 20 312 000       | 04/05/2023         | BNP Paribas                 | (3 579)  | (0,00)        |
| USD               | AUD              | 104 644           | 156 000          | 04/05/2023         | Westpac Banking Corporation | 51   | 0,00          |
| USD               | CAD              | 26 685 731        | 36 282 000       | 05/04/2023         | Royal Bank of Canada        | (124 040)                                      | (0,00)        |
| USD               | CAD              | 117 390           | 159 000          | 05/04/2023         | BNP Paribas                 | (99)   | (0,00)        |
| USD               | CAD              | 23 923 150        | 32 393 000       | 04/05/2023         | Barclays Bank               | (23 143)                                       | (0,00)        |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

Instruments financiers dérivés – 1,60 % (mars 2022 : 1,53 %) (suite)

Contrats de change à terme – 0,34 % (mars 2022 : 0,52 %) (suite)

| Devise achetée | Devise vendue | Montant acheté | Montant vendu  | Date d'échéance | Contrepartie                | Plus-values/<br>(Moins-values)<br>latentes<br>USD | % du<br>Comp. |
|----------------|---------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------------------|---|---------------|
| USD            | CAD           | 2 987 503      | 4 048 000      | 04/05/2023      | HSBC Bank                   | (4 952)   | (0,00)        |
| USD            | CAD           | 198 950        | 271 000        | 04/05/2023      | Westpac Banking Corporation | (1 385)   | (0,00)        |
| USD            | CHF           | 120 859 333    | 110 658 805    | 05/04/2023      | Citibank                    | (284 260)   | (0,01)        |
| USD            | CHF           | 12 480 828     | 11 654 697     | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (278 138)   | (0,01)        |
| USD            | CHF           | 120 859 334    | 110 646 720    | 05/04/2023      | JP Morgan Chase Bank        | (271 029)   | (0,01)        |
| USD            | CHF           | 120 859 333    | 110 586 290    | 05/04/2023      | Barclays Bank               | (204 874)   | (0,01)        |
| USD            | CHF           | 5 074 457      | 4 755 000      | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | (131 073)   | (0,00)        |
| USD            | CHF           | 5 271 214      | 4 809 000      | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | (9 856)   | (0,00)        |
| USD            | CLP           | 60 591         | 48 462 000     | 05/04/2023      | UBS AG                      | (703)   | (0,00)        |
| USD            | CLP           | 60 017         | 48 462 000     | 04/05/2023      | Merrill Lynch International | (1 069)   | (0,00)        |
| USD            | CNY           | 84 647 769     | 588 627 000    | 06/04/2023      | BNP Paribas                 | (1 026 753)                                       | (0,03)        |
| USD            | CNY           | 685 880        | 4 758 000      | 06/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (6 684)   | (0,00)        |
| USD            | CNY           | 86 232 696     | 592 410 000    | 04/05/2023      | JP Morgan Chase Bank        | (202 315)   | (0,01)        |
| USD            | CNY           | 655 836        | 4 496 000      | 04/05/2023      | Westpac Banking Corporation | (783)   | (0,00)        |
| USD            | COP           | 559 189        | 2 773 075 000  | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | (35 893)  | (0,00)        |
| USD            | COP           | 577 726        | 2 773 075 000  | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | (13 584)  | (0,00)        |
| USD            | CZK           | 1 134 820      | 25 455 000     | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | (43 100)  | (0,00)        |
| USD            | CZK           | 1 174 472      | 25 455 000     | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | (1 637)   | (0,00)        |
| USD            | DKK           | 1 784 204      | 12 548 000     | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | (45 988)  | (0,00)        |
| USD            | DKK           | 1 835 632      | 12 548 000     | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | 1 957   | 0,00          |
| USD            | EUR           | 102 007 958    | 96 470 001     | 05/04/2023      | HSBC Bank                   | (2 807 569)                                       | (0,10)        |
| USD            | EUR           | 102 027 346    | 96 469 999     | 05/04/2023      | Goldman Sachs               | (2 788 179)                                       | (0,10)        |
| USD            | EUR           | 99 971 010     | 92 594 144     | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (633 366)   | (0,02)        |
| USD            | EUR           | 2 500 000      | 2 355 092      | 05/04/2023      | Barclays Bank               | (58 829)  | (0,00)        |
| USD            | EUR           | 901 581        | 849 000        | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | (20 865)  | (0,00)        |
| USD            | EUR           | 65 735 999     | 60 506 912     | 05/04/2023      | Citibank                    | (5 308)   | (0,00)        |
| USD            | EUR           | 65 735 999     | 60 502 530     | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | (546)   | (0,00)        |
| USD            | EUR           | 5 276 000      | 4 883 967      | 04/05/2023      | Barclays Bank               | (39 117)  | (0,00)        |
| USD            | EUR           | 5 562 334      | 5 131 236      | 04/05/2023      | Westpac Banking Corporation | (21 882)  | (0,00)        |
| USD            | EUR           | 105 361 308    | 96 820 999     | 04/05/2023      | Citibank                    | (6 942)   | (0,00)        |
| USD            | EUR           | 105 369 037    | 96 821 001     | 04/05/2023      | Merrill Lynch International | 783   | 0,00          |
| USD            | EUR           | 336 000        | 307 884        | 04/05/2023      | Royal Bank of Canada        | 937   | 0,00          |
| USD            | EUR           | 928 000        | 849 399        | 04/05/2023      | Westpac Banking Corporation | 3 616   | 0,00          |
| USD            | EUR           | 2 013 000      | 1 841 358      | 04/05/2023      | Barclays Bank               | 9 089   | 0,00          |
| USD            | GBP           | 38 016 782     | 31 708 000     | 05/04/2023      | JP Morgan Chase Bank        | (1 189 382)                                       | (0,05)        |
| USD            | GBP           | 7 365 999      | 5 984 076      | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (33 163)  | (0,00)        |
| USD            | GBP           | 6 274 002      | 5 080 797      | 05/04/2023      | UBS AG                      | (8 279)   | (0,00)        |
| USD            | GBP           | 6 273 999      | 5 080 572      | 05/04/2023      | Barclays Bank               | (8 004)   | (0,00)        |
| USD            | GBP           | 166 044        | 138 000        | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | (4 589)   | (0,00)        |
| USD            | GBP           | 38 602 511     | 31 257 000     | 04/05/2023      | Westpac Banking Corporation | (69 214)  | (0,00)        |
| USD            | GBP           | 111 000        | 89 600         | 04/05/2023      | Barclays Bank               | 146   | 0,00          |
| USD            | HKD           | 27 189         | 213 000        | 06/04/2023      | BNP Paribas                 | 53  | 0,00          |
| USD            | HKD           | 27 181         | 213 000        | 04/05/2023      | HSBC Bank                   | 3   | 0,00          |
| USD            | HUF           | 480 334        | 174 702 000    | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | (18 523)  | (0,00)        |
| USD            | HUF           | 493 465        | 174 702 000    | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | (623)   | (0,00)        |
| USD            | IDR           | 4 377 491      | 66 629 786 000 | 05/04/2023      | HSBC Bank                   | (66 180)  | (0,00)        |
| USD            | IDR           | 4 407 693      | 66 629 786 000 | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | (33 828)  | (0,00)        |
| USD            | ILS           | 1 346 994      | 4 940 000      | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | (25 007)  | (0,00)        |
| USD            | ILS           | 1 376 152      | 4 940 000      | 04/05/2023      | HSBC Bank                   | 3 163   | 0,00          |
| USD            | JPY           | 56 978 416     | 7 727 333 000  | 05/04/2023      | JP Morgan Chase Bank        | (1 090 802)                                       | (0,04)        |
| USD            | JPY           | 56 990 981     | 7 727 332 999  | 05/04/2023      | Royal Bank of Canada        | (1 078 237)                                       | (0,04)        |
| USD            | JPY           | 2 443 407      | 330 381 000    | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (39 334)  | (0,00)        |
| USD            | JPY           | 503 705        | 67 576 000     | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | (4 114)   | (0,00)        |
| USD            | JPY           | 60 806 449     | 8 033 091 999  | 08/05/2023      | Westpac Banking Corporation | 151 737   | 0,00          |
| USD            | JPY           | 59 914 519     | 7 913 318 000  | 08/05/2023      | HSBC Bank                   | 164 173   | 0,00          |
| USD            | KRW           | 133 384        | 175 758 000    | 05/04/2023      | HSBC Bank                   | (1 600)   | (0,00)        |
| USD            | KRW           | 10 410 785     | 13 535 009 000 | 05/04/2023      | Royal Bank of Canada        | 13 701  | 0,00          |
| USD            | KRW           | 10 697 162     | 13 710 767 000 | 04/05/2023      | JP Morgan Chase Bank        | 147 152   | 0,00          |
| USD            | MXN           | 3 053 382      | 56 413 000     | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | (70 311)  | (0,00)        |
| USD            | MXN           | 3 099 049      | 56 413 000     | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | (7 136)   | (0,00)        |
| USD            | MYR           | 3 117 422      | 13 832 000     | 05/04/2023      | Goldman Sachs               | (17 582)  | (0,00)        |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

Instruments financiers dérivés – 1,60 % (mars 2022 : 1,53 %) (suite)

Contrats de change à terme – 0,34 % (mars 2022 : 0,52 %)^ (suite)

| Devise achetée  | Devise vendue | Montant acheté | Montant vendu | Date d'échéance | Contrepartie                | Plus-values/<br>(Moins-values)<br>latentes<br>USD | % du<br>Comp. |
|---|---------------|----------------|---------------|-----------------|-----------------------------|---|---------------|
| USD   | MYR           | 3 139 355      | 13 832 000    | 08/05/2023      | Goldman Sachs               | (2 491)   | (0,00)        |
| USD   | NOK           | 597 861        | 6 198 000     | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | 6 032   | 0,00          |
| USD   | NOK           | 594 967        | 6 198 000     | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | 2 336   | 0,00          |
| USD   | NZD           | 1 452 299      | 2 365 000     | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | (27 371)  | (0,00)        |
| USD   | NZD           | 1 475 808      | 2 365 000     | 04/05/2023      | HSBC Bank                   | (3 926)   | (0,00)        |
| USD   | PEN           | 444 488        | 1 704 000     | 05/04/2023      | Barclays Bank               | (8 542)   | (0,00)        |
| USD   | PEN           | 451 450        | 1 704 000     | 04/05/2023      | Standard Chartered Bank     | (593)   | (0,00)        |
| USD   | PLN           | 1 797 432      | 8 049 000     | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | (70 827)  | (0,00)        |
| USD   | PLN           | 1 866 335      | 8 049 000     | 04/05/2023      | HSBC Bank                   | 1 436   | 0,00          |
| USD   | RON           | 439 826        | 2 052 000     | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | (10 780)  | (0,00)        |
| USD   | RON           | 450 502        | 2 052 000     | 04/05/2023      | HSBC Bank                   | 312   | 0,00          |
| USD   | SEK           | 3 712 020      | 38 813 000    | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | (31 169)  | (0,00)        |
| USD   | SEK           | 80 120         | 834 000       | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (312)   | (0,00)        |
| USD   | SEK           | 3 821 150      | 39 647 000    | 04/05/2023      | BNP Paribas                 | (8 818)   | (0,00)        |
| USD   | SGD           | 1 950 087      | 2 630 000     | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | (28 086)  | (0,00)        |
| USD   | SGD           | 1 980 932      | 2 630 000     | 04/05/2023      | HSBC Bank                   | 932   | 0,00          |
| USD   | THB           | 2 973 855      | 102 598 000   | 05/04/2023      | Citibank                    | (26 826)  | (0,00)        |
| USD   | THB           | 3 025 151      | 102 598 000   | 08/05/2023      | Barclays Bank               | 13 810  | 0,00          |
| <b>Plus-values latentes sur contrats de change à terme</b>        |               |                |               |                 |                             | <b>25 139 055</b>                                 | <b>0,86</b>   |
| <b>Moins-values latentes sur contrats de change à terme</b>       |               |                |               |                 |                             | <b>(15 971 218)</b>                               | <b>(0,52)</b> |
| <b>Plus-values latentes nettes sur contrats de change à terme</b> |               |                |               |                 |                             | <b>9 167 837</b>                                  | <b>0,34</b>   |

Titres TBA – 1,26 % (mars 2022 : 1,01 %)

| Montant nominal | Investissement         | Coupon | Date d'expiration | Contrepartie          | Juste valeur | % des actifs nets |
|-----------------|------------------------|--------|-------------------|-----------------------|--------------|-------------------|
| 250 000         | Fannie Mae Pool TBA    | 6,000  | 13/04/2023        | Citigroup             | 255 186      | 0,01              |
| 150 000         | Fannie Mae Pool TBA    | 6,500  | 13/04/2023        | Goldman Sachs         | 154 840      | 0,01              |
| 500 000         | Ginnie Mae II Pool TBA | 5,000  | 20/04/2023        | Mizuho Securities     | 500 605      | 0,02              |
| 350 000         | Fannie Mae Pool TBA    | 4,500  | 17/04/2038        | Bank of America       | 348 972      | 0,01              |
| 275 000         | Fannie Mae Pool TBA    | 4,000  | 17/04/2038        | Bank of America       | 270 723      | 0,01              |
| 450 000         | Fannie Mae Pool TBA    | 3,500  | 17/04/2038        | Citigroup             | 435 205      | 0,02              |
| 700 000         | Fannie Mae Pool TBA    | 2,500  | 17/04/2038        | Goldman Sachs         | 649 356      | 0,02              |
| 570 000         | Fannie Mae Pool TBA    | 2,000  | 17/04/2038        | JPMorgan Chase        | 514 678      | 0,02              |
| 150 000         | Fannie Mae Pool TBA    | 1,500  | 17/04/2038        | JPMorgan Chase        | 131 959      | 0,00              |
| 250 000         | Fannie Mae Pool TBA    | 6,500  | 13/04/2053        | Bank of America       | 257 968      | 0,01              |
| 2 375 000       | Fannie Mae Pool TBA    | 2,000  | 13/04/2053        | Barclays Bank         | 1 962 368    | 0,07              |
| 1 875 000       | Fannie Mae Pool TBA    | 5,000  | 13/04/2053        | Barclays Bank         | 1 869 208    | 0,07              |
| 900 000         | Fannie Mae Pool TBA    | 6,000  | 13/04/2053        | Barclays Bank         | 918 306      | 0,03              |
| 3 200 000       | Fannie Mae Pool TBA    | 4,000  | 13/04/2053        | Goldman Sachs         | 3 058 931    | 0,11              |
| 1 375 000       | Fannie Mae Pool TBA    | 5,500  | 13/04/2053        | Goldman Sachs         | 1 388 764    | 0,05              |
| 250 000         | Fannie Mae Pool TBA    | 3,000  | 13/04/2053        | Goldman Sachs         | 224 110      | 0,01              |
| 750 000         | Fannie Mae Pool TBA    | 5,500  | 13/04/2053        | JPMorgan Chase        | 757 910      | 0,03              |
| 750 000         | Fannie Mae Pool TBA    | 5,000  | 13/04/2053        | JPMorgan Chase        | 748 184      | 0,03              |
| 350 000         | Fannie Mae Pool TBA    | 2,000  | 13/04/2053        | JPMorgan Chase        | 289 191      | 0,01              |
| 200 000         | Fannie Mae Pool TBA    | 4,500  | 13/04/2053        | JPMorgan Chase        | 195 868      | 0,01              |
| 5 650 000       | Fannie Mae Pool TBA    | 3,500  | 13/04/2053        | Morgan Stanley        | 5 245 720    | 0,20              |
| 2 625 000       | Fannie Mae Pool TBA    | 4,500  | 13/04/2053        | Morgan Stanley        | 2 570 770    | 0,10              |
| 700 000         | Fannie Mae Pool TBA    | 3,000  | 13/04/2053        | Morgan Stanley        | 627 509      | 0,02              |
| 200 000         | Fannie Mae Pool TBA    | 6,000  | 13/04/2053        | Wells Fargo & Company | 204 068      | 0,01              |
| 200 000         | Fannie Mae Pool TBA    | 4,000  | 13/04/2053        | Wells Fargo & Company | 191 183      | 0,01              |
| 4 500 000       | Ginnie Mae II Pool TBA | 3,000  | 20/04/2053        | Barclays Bank         | 4 093 380    | 0,15              |
| 1 150 000       | Ginnie Mae II Pool TBA | 5,000  | 20/04/2053        | Barclays Bank         | 1 151 093    | 0,04              |
| 975 000         | Ginnie Mae II Pool TBA | 4,500  | 20/04/2053        | Barclays Bank         | 960 398      | 0,04              |
| 150 000         | Ginnie Mae II Pool TBA | 2,500  | 20/04/2053        | Barclays Bank         | 132 006      | 0,00              |
| 1 175 000       | Ginnie Mae II Pool TBA | 3,500  | 20/04/2053        | Citigroup             | 1 101 625    | 0,04              |
| 200 000         | Ginnie Mae II Pool TBA | 4,000  | 20/04/2053        | Citigroup             | 192 475      | 0,01              |
| 200 000         | Ginnie Mae II Pool TBA | 2,500  | 20/04/2053        | Citigroup             | 176 007      | 0,01              |
| 975 000         | Ginnie Mae II Pool TBA | 5,500  | 20/04/2053        | Goldman Sachs         | 986 119      | 0,04              |

## SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

Instruments financiers dérivés – 1,60 % (mars 2022 : 1,53 %) (suite)

Titres TBA – 1,26 % (mars 2022 : 1,01 %) (suite)

| Montant nominal | Investissement                                  | Coupon | Date d'expiration | Contrepartie      | Juste valeur      | % des actifs nets |
|-----------------|---|--------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 75 000          | Ginnie Mae II Pool TBA                          | 2,000  | 20/04/2053        | Goldman Sachs     | 63 661            | 0,00              |
| 150 000         | Ginnie Mae II Pool TBA                          | 3,000  | 20/04/2053        | Mizuho Securities | 136 446           | 0,01              |
| 875 000         | Ginnie Mae II Pool TBA                          | 4,000  | 20/04/2053        | Morgan Stanley    | 842 076           | 0,03              |
|                 | <b>Total des achats de Titres TBA</b>           |        |                   |                   | <b>33 606 868</b> | <b>1,26</b>       |
|                 | <b>Titres TBA nets</b>                          |        |                   |                   | <b>33 606 868</b> | <b>1,26</b>       |
|                 | <b>Total des instruments financiers dérivés</b> |        |                   |                   | <b>42 774 705</b> | <b>1,60</b>       |

|   | Juste valeur USD     | % du Comp.    |
|---|----------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | 2 642 778 128        | 99,26         |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 2,18 %)</b>                               | 41 378 838           | 1,55          |
| <b>Découverts bancaires (mars 2022 : néant)</b>                                     | (384 790)            | (0,01)        |
| <b>Autres passifs nets (mars 2022 : (1,63 %))</b>                                   | (21 379 375)         | (0,80)        |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>2 662 392 801</b> | <b>100,00</b> |

^ Des Contrats de change à terme sont utilisés à des fins de couverture.

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company.

\*\* Le Compartiment a reçu 570 000 Gilts (3.500% United Kingdom Gilt 22/07/2068) de BNP Paribas, d'une valeur de marché de 598 317 USD, en garantie pour des instruments financiers dérivés détenus par le Compartiment au 31 mars 2023. Ces garanties ne sont pas comptabilisées dans les actifs du Compartiment.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

|  | % du total des actifs |
|--|-----------------------|
| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                                   |                       |
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs            | 70,08                 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé                        | 14,52                 |
| Autres valeurs mobilières du type mentionné dans le Règlement 68(1)(a), (b) et (c) | 10,32                 |
| Instruments financiers dérivés négociés de gré à gré                               | 2,15                  |
| Autres actifs  | 2,93                  |
| <b>Total des actifs</b>  | <b>100,00</b>         |

## SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD        | 2022<br>USD        |
|---|-------|--------------------|--------------------|
| <b>Actifs circulants</b>  |       |                    |                    |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :            |       |                    |                    |
| Valeurs mobilières  | 1(e)  | 354 226 129        | 415 415 184        |
|   |       | <b>354 226 129</b> | <b>415 415 184</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie   | 1(f)  | 807 339            | 845 000            |
| Créances :  |       |                    |                    |
| Intérêts à recevoir   |       | 737 009            | 711 157            |
| À recevoir sur cessions d'investissements   |       | 2 355 735          | 3 645 405          |
| <b>Total des actifs circulants</b>  |       | <b>358 126 212</b> | <b>420 616 746</b> |
| <b>Passifs circulants</b>   |       |                    |                    |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :  |       |                    |                    |
| Charges à payer   |       | (50 159)           | (62 933)           |
| À payer sur achats d'investissements  |       | (2 711 906)        | (3 944 733)        |
| <b>Total des passifs circulants</b>   |       | <b>(2 762 065)</b> | <b>(4 007 666)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> |       | <b>355 364 147</b> | <b>416 609 080</b> |
|   |       | <b>2023</b>        | <b>2022</b>        |
|   |       | <b>2021</b>        |                    |
| Valeur liquidative par action   | 5     | 29,51 USD          | 33,74 USD          |
|   |       |                    | 34,02 USD          |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.



## SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD         | 2022<br>USD        |
|---|-------|---------------------|--------------------|
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 27 030 544          | 28 011 197         |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 9     | (50 649 402)        | (6 316 272)        |
| Produits divers   |       | 15 596              | -                  |
| <b>Total des (charges)/revenus d'investissement</b>   |       | <b>(23 603 262)</b> | <b>21 694 925</b>  |
| Charges opérationnelles   | 3     | (663 348)           | (819 138)          |
| Rendement négatif   |       | (4 324 874)         | -                  |
| <b>(Perte)/Bénéfice net(te) pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>                               |       | <b>(28 591 484)</b> | <b>20 875 787</b>  |
| <b>Charges financières</b>  |       |                     |                    |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables   | 7     | (24 482 960)        | (22 638 552)       |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(53 074 444)</b> | <b>(1 762 765)</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>USD         | 2022<br>USD         |
|---|---------------------|---------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier               | 416 609 080         | 487 684 620         |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(53 074 444)</b> | <b>(1 762 765)</b>  |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                     |                     |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 179 307 081         | 238 630 226         |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (187 477 570)       | (307 943 001)       |
| Diminution des actifs nets résultant d'opérations sur actions   | (8 170 489)         | (69 312 775)        |
| <b>Diminution totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                   | <b>(61 244 933)</b> | <b>(71 075 540)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>        | <b>355 364 147</b>  | <b>416 609 080</b>  |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

| Notes   | 2023<br>USD         | 2022<br>USD         |
|---|---------------------|---------------------|
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(53 074 444)</b> | <b>(1 762 765)</b>  |
| <b>Ajustement pour :</b>  |                     |                     |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 61 245 898          | 67 388 307          |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   | <b>8 171 454</b>    | <b>65 625 542</b>   |
| Variation des montants à recevoir   | (25 852)            | 182 279             |
| Variation des montants à payer  | (12 774)            | (12 733)            |
| <b>(Sorties)/Entrées de trésorerie sur opérations</b>   | <b>(38 626)</b>     | <b>169 546</b>      |
| <b>Entrées de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  | <b>8 132 828</b>    | <b>65 795 088</b>   |
| <b>Activités de financement</b>   |                     |                     |
| Produits des souscriptions  | 5 179 307 081       | 242 030 725         |
| Paiements sur rachats   | 5 (187 477 570)     | (307 943 001)       |
| <b>Trésorerie nette utilisée sur activités de financement</b>   | <b>(8 170 489)</b>  | <b>(65 912 276)</b> |
| <b>Diminution nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>   | <b>(37 661)</b>     | <b>(117 188)</b>    |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  | 845 000             | 962 188             |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   | <b>807 339</b>      | <b>845 000</b>      |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |                     |                     |
| Intérêts reçus  | 27 055 734          | 33 638 198          |
| Distributions payées  | (24 482 960)        | (22 638 552)        |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                              | Juste valeur USD   | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD   | % des actifs nets        |
|---|--|-------------------|---|--|--------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,68 % (mars 2022 : 99,71 %)</b> |  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,68 % (mars 2022 : 99,71 %)</b>         |  |                          |
| <b>Obligations d'État – 99,68 % (mars 2022 : 99,71 %)</b> |  |                   | <b>(suite)</b>  |  |                          |
| <b>Dollar américain – 99,68 %</b>                         |  |                   | <b>Obligations d'État – 99,68 % (mars 2022 : 99,71 %) (suite)</b> |  |                          |
| <b>Dollar américain – 99,68 % (suite)</b>                 |  |                   | <b>Dollar américain – 99,68 % (suite)</b>                         |  |                          |
| 6 536 681   | 0.500% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/04/2024 | 6 436 915 1,81    | 9 897 525   | 1.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2030 | 9 226 082 2,60           |
| 11 060 811  | 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2024 | 10 848 548 3,05   | 9 788 521   | 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2030 | 9 111 741 2,56           |
| 8 815 477   | 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/10/2024 | 8 616 053 2,42    | 10 535 963  | 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2031 | 9 740 933 2,74           |
| 11 521 478  | 0.250% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2025 | 11 252 912 3,17   | 11 921 480  | 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2031 | 10 984 061 3,09          |
| 9 386 936   | 2.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2025 | 9 509 562 2,68    | 11 708 982  | 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2032 | 10 699 451 3,01          |
| 9 419 329   | 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/04/2025 | 9 133 602 2,57    | 965 522   | 3.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/04/2032 | 1 141 908 0,32           |
| 11 995 306  | 0.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2025 | 11 742 430 3,30   | 11 531 451  | 0.625% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2032 | 11 018 624 3,10          |
| 8 526 596   | 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/10/2025 | 8 269 126 2,33    | 6 428 876   | 1.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2033 | 6 416 804 1,81           |
| 10 949 992  | 0.625% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2026 | 10 714 419 3,02   | 4 049 679   | 2.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2040 | 4 470 019 1,26           |
| 5 883 546   | 2.000% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2026 | 5 973 097 1,68    | 6 830 675   | 2.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2041 | 7 538 802 2,12           |
| 9 638 281   | 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/04/2026 | 9 254 780 2,60    | 6 502 431   | 0.750% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2042 | 5 678 555 1,60           |
| 9 129 632   | 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2026 | 8 798 714 2,48    | 6 302 307   | 0.625% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2043 | 5 317 609 1,50           |
| 9 134 020   | 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/10/2026 | 8 775 892 2,47    | 5 987 423   | 1.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2044 | 5 796 485 1,63           |
| 9 750 667   | 0.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2027 | 9 404 278 2,65    | 6 249 216   | 0.750% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2045 | 5 325 406 1,50           |
| 4 700 897   | 2.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2027 | 4 876 728 1,37    | 5 591 912   | 1.000% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2046 | 5 001 347 1,41           |
| 8 966 000   | 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/04/2027 | 8 543 549 2,40    | 5 391 267   | 0.875% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2047 | 4 662 947 1,31           |
| 9 217 860   | 0.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2027 | 8 907 675 2,51    | 4 935 249   | 1.000% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2048 | 4 391 905 1,24           |
| 8 640 756   | 1.625% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/10/2027 | 8 811 574 2,48    | 4 326 504   | 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2049 | 3 838 277 1,08           |
| 10 253 323  | 0.500% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2028 | 9 905 711 2,79    | 3 281 839   | 0.250% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2050 | 2 382 292 0,67           |
| 3 710 683   | 1.750% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2028 | 3 799 654 1,07    | 4 059 895   | 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2051 | 2 813 820 0,79           |
| 6 499 827   | 3.625% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/04/2028 | 7 258 930 2,04    | 4 714 498   | 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2052 | 3 271 936 0,92           |
| 9 397 223   | 0.750% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2028 | 9 219 075 2,59    | 2 213 618   | 1.500% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2053 | 2 249 395 0,63           |
| 9 151 380   | 0.875% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2029 | 8 993 614 2,53    |   |  |                          |
| 4 208 321   | 2.500% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2029 | 4 508 534 1,27    |   | <b>Total des obligations d'État</b>                              | <b>354 226 129 99,68</b> |
| 8 089 327   | 3.875% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/04/2029 | 9 325 165 2,62    |   | <b>Total des valeurs mobilières</b>                              | <b>354 226 129 99,68</b> |
| 10 831 041  | 0.250% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2029 | 10 267 193 2,89   |   |  |                          |

## SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

|   | Juste valeur<br>USD       | % du<br>Comp.        |
|---|---------------------------|----------------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | 354 226 129               | 99,68                |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 :<br/>0,20 %)</b>                               | 807 339                   | 0,23                 |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : 0,09 %)</b>  | <u>330 679</u>            | <u>0,09</u>          |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs<br/>d'actions de participation rachetables</b> | <u><b>355 364 147</b></u> | <u><b>100,00</b></u> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                        | <b>% du<br/>total<br/>des actifs</b> |
|---|--------------------------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs | 75,36                                |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé             | 23,55                                |
| Autres actifs   | <u>1,09</u>                          |
| <b>Total des actifs</b>   | <u><b>100,00</b></u>                 |

## SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD        | 2022<br>USD         |
|--|-------|--------------------|---------------------|
| <b>Actifs circulants</b>   |       |                    |                     |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                         |       |                    |                     |
| Valeurs mobilières   | 1(e)  | 485 619 522        | 519 152 862         |
|  |       | <b>485 619 522</b> | <b>519 152 862</b>  |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie  | 1(f)  | 1 526 406          | 825 311             |
| Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties à des instruments financiers ouverts | 1(g)  | 111                | -                   |
| Créances :   |       |                    |                     |
| Intérêts à recevoir  |       | 2 657 068          | 2 065 520           |
| À recevoir sur cessions d'investissements  |       | 6 112 040          | 4 554 596           |
| À recevoir sur cessions d'actions de fonds   |       | -                  | 52 706 533          |
| <b>Total des actifs circulants</b>   |       | <b>495 915 147</b> | <b>579 304 822</b>  |
| <b>Passifs circulants</b>  |       |                    |                     |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :   |       |                    |                     |
| Charges à payer  |       | (60 692)           | (59 009)            |
| À payer sur achats d'investissements   |       | (6 963 916)        | (57 277 259)        |
| <b>Total des passifs circulants</b>  |       | <b>(7 024 608)</b> | <b>(57 336 268)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>              |       | <b>488 890 539</b> | <b>521 968 554</b>  |
|  |       | <b>2023</b>        | <b>2022</b>         |
|  |       | <b>2021</b>        |                     |
| Valeur liquidative par action  | 5     | 98,88 USD          | 105,48 USD          |
|  |       |                    | 110,72 USD          |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD         | 2022<br>USD         |
|---|-------|---------------------|---------------------|
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 11 415 861          | 5 120 175           |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 9     | (37 849 173)        | (21 933 993)        |
| Produits divers   |       | 14 593              | -                   |
| <b>Total des charges d'investissement</b>   |       | <b>(26 418 719)</b> | <b>(16 813 818)</b> |
| Charges opérationnelles   | 3     | (822 308)           | (680 928)           |
| <b>Perte nette pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(27 241 027)</b> | <b>(17 494 746)</b> |
| <b>Charges financières</b>  |       |                     |                     |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables   | 7     | (9 026 794)         | (4 293 771)         |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(36 267 821)</b> | <b>(21 788 517)</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>USD         | 2022<br>USD         |
|---|---------------------|---------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier               | 521 968 554         | 480 800 488         |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(36 267 821)</b> | <b>(21 788 517)</b> |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                     |                     |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 287 735 135         | 222 764 962         |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (284 545 329)       | (159 808 379)       |
| Augmentation des actifs nets résultant d'opérations sur actions   | 3 189 806           | 62 956 583          |
| <b>(Diminution)/Augmentation totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>    | <b>(33 078 015)</b> | <b>41 168 066</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>        | <b>488 890 539</b>  | <b>521 968 554</b>  |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.



## SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

| Notes   | 2023<br>USD         | 2022<br>USD         |
|---|---------------------|---------------------|
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(36 267 821)</b> | <b>(21 788 517)</b> |
| <b>Ajustement pour :</b>  |                     |                     |
| Variation de la trésorerie détenue par/à payer au courtier  | (111)               | -                   |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | (18 337 447)        | 11 321 620          |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   | <b>(54 605 379)</b> | <b>(10 466 897)</b> |
| Variation des montants à recevoir   | (591 548)           | (44 688)            |
| Variation des montants à payer  | 1 683               | (3 303)             |
| <b>Sorties de trésorerie sur opérations</b>   | <b>(589 865)</b>    | <b>(47 991)</b>     |
| <b>Sorties de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  | <b>(55 195 244)</b> | <b>(10 514 888)</b> |
| <b>Activités de financement</b>   |                     |                     |
| Produits des souscriptions  | 5 340 441 668       | 170 058 429         |
| Paiements sur rachats   | 5 (284 545 329)     | (159 808 379)       |
| <b>Trésorerie nette générée sur activités de financement</b>  | <b>55 896 339</b>   | <b>10 250 050</b>   |
| <b>Augmentation/(Diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>                                    | <b>701 095</b>      | <b>(264 838)</b>    |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  | 825 311             | 1 090 149           |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   | <b>1 526 406</b>    | <b>825 311</b>      |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |                     |                     |
| Intérêts reçus  | 10 255 286          | 7 549 750           |
| Distributions payées  | (9 026 794)         | (4 293 771)         |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                                 | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %)</b>    |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %)</b>         |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %)</b>    |                  |                   | <b>(suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,33 %</b>                            |                  |                   | <b>Obligations d'État – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,33 % (suite)</b>                    |                  |                   | <b>Dollar américain – 99,33 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 1 406 000 0.375% United States Treasury Note/Bond 15/04/2024 | 1 345 410        | 0,28              | 1 325 000 1.500% United States Treasury Note/Bond 31/10/2024      | 1 268 946        | 0,26              |
| 1 208 000 2.000% United States Treasury Note/Bond 30/04/2024 | 1 174 638        | 0,24              | 1 252 000 2.250% United States Treasury Note/Bond 31/10/2024      | 1 213 217        | 0,25              |
| 1 730 000 2.250% United States Treasury Note/Bond 30/04/2024 | 1 686 750        | 0,35              | 1 796 000 4.375% United States Treasury Note/Bond 31/10/2024      | 1 798 035        | 0,37              |
| 2 418 000 2.500% United States Treasury Note/Bond 30/04/2024 | 2 364 162        | 0,48              | 2 826 000 0.750% United States Treasury Note/Bond 15/11/2024      | 2 671 122        | 0,55              |
| 2 250 000 0.250% United States Treasury Note/Bond 15/05/2024 | 2 145 322        | 0,44              | 2 761 000 2.250% United States Treasury Note/Bond 15/11/2024      | 2 673 964        | 0,55              |
| 2 751 000 2.500% United States Treasury Note/Bond 15/05/2024 | 2 689 747        | 0,55              | 241 000 7.500% United States Treasury Note/Bond 15/11/2024        | 253 022          | 0,05              |
| 1 825 000 2.000% United States Treasury Note/Bond 31/05/2024 | 1 773 387        | 0,36              | 1 524 000 1.500% United States Treasury Note/Bond 30/11/2024      | 1 457 563        | 0,30              |
| 2 148 000 2.500% United States Treasury Note/Bond 31/05/2024 | 2 099 250        | 0,43              | 1 355 000 2.125% United States Treasury Note/Bond 30/11/2024      | 1 309 110        | 0,27              |
| 2 313 000 0.250% United States Treasury Note/Bond 15/06/2024 | 2 198 886        | 0,45              | 1 838 000 4.500% United States Treasury Note/Bond 30/11/2024      | 1 845 108        | 0,38              |
| 1 598 000 1.750% United States Treasury Note/Bond 30/06/2024 | 1 545 940        | 0,32              | 2 230 000 1.000% United States Treasury Note/Bond 15/12/2024      | 2 113 012        | 0,43              |
| 1 236 000 2.000% United States Treasury Note/Bond 30/06/2024 | 1 199 017        | 0,25              | 1 744 000 1.750% United States Treasury Note/Bond 31/12/2024      | 1 672 946        | 0,34              |
| 2 143 000 3.000% United States Treasury Note/Bond 30/06/2024 | 2 104 242        | 0,43              | 1 285 000 3.000% United States Treasury Note/Bond 31/12/2024      | 1 242 836        | 0,25              |
| 2 038 000 0.375% United States Treasury Note/Bond 15/07/2024 | 1 935 224        | 0,40              | 2 100 000 4.250% United States Treasury Note/Bond 31/12/2024      | 2 101 723        | 0,43              |
| 1 794 000 1.750% United States Treasury Note/Bond 31/07/2024 | 1 732 191        | 0,35              | 2 238 000 1.125% United States Treasury Note/Bond 15/01/2025      | 2 120 855        | 0,43              |
| 1 067 000 2.125% United States Treasury Note/Bond 31/07/2024 | 1 035 365        | 0,21              | 901 000 1.375% United States Treasury Note/Bond 31/01/2025        | 857 428          | 0,18              |
| 2 070 000 3.000% United States Treasury Note/Bond 31/07/2024 | 2 031 915        | 0,42              | 1 569 000 2.500% United States Treasury Note/Bond 31/01/2025      | 1 523 340        | 0,31              |
| 2 518 000 0.375% United States Treasury Note/Bond 15/08/2024 | 2 384 133        | 0,49              | 2 000 000 4.125% United States Treasury Note/Bond 31/01/2025      | 1 999 531        | 0,41              |
| 2 789 000 2.375% United States Treasury Note/Bond 15/08/2024 | 2 714 699        | 0,56              | 2 066 000 1.500% United States Treasury Note/Bond 15/02/2025      | 1 967 946        | 0,40              |
| 1 526 000 1.250% United States Treasury Note/Bond 31/08/2024 | 1 461 026        | 0,30              | 2 350 000 2.000% United States Treasury Note/Bond 15/02/2025      | 2 259 121        | 0,46              |
| 1 223 000 1.875% United States Treasury Note/Bond 31/08/2024 | 1 181 342        | 0,24              | 165 000 7.625% United States Treasury Note/Bond 15/02/2025        | 175 158          | 0,04              |
| 1 918 000 3.250% United States Treasury Note/Bond 31/08/2024 | 1 888 631        | 0,39              | 1 806 000 1.125% United States Treasury Note/Bond 28/02/2025      | 1 707 517        | 0,35              |
| 2 548 000 0.375% United States Treasury Note/Bond 15/09/2024 | 2 407 163        | 0,49              | 860 000 2.750% United States Treasury Note/Bond 28/02/2025        | 838 601          | 0,17              |
| 1 521 000 1.500% United States Treasury Note/Bond 30/09/2024 | 1 458 972        | 0,30              | 1 652 000 4.625% United States Treasury Note/Bond 28/02/2025      | 1 668 068        | 0,34              |
| 1 131 000 2.125% United States Treasury Note/Bond 30/09/2024 | 1 095 126        | 0,22              | 2 560 000 1.750% United States Treasury Note/Bond 15/03/2025      | 2 448 600        | 0,50              |
| 1 821 000 4.250% United States Treasury Note/Bond 30/09/2024 | 1 818 937        | 0,37              | 2 130 000 0.500% United States Treasury Note/Bond 31/03/2025      | 1 986 641        | 0,41              |
| 2 674 000 0.625% United States Treasury Note/Bond 15/10/2024 | 2 528 810        | 0,52              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,33 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 99,33 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 749 000 2.625% United States Treasury Note/Bond 30/03/2025        | 728 841          | 0,15              | 2 877 000 4.000% United States Treasury Note/Bond 15/11/2025      | 2 761 021        | 0,56              |
| 2 616 000 2.625% United States Treasury Note/Bond 15/04/2025      | 2 542 221        | 0,52              | 1 900 000 4.500% United States Treasury Note/Bond 15/11/2025      | 1 928 203        | 0,39              |
| 2 230 000 0.375% United States Treasury Note/Bond 30/04/2025      | 2 068 325        | 0,42              | 2 380 000 0.375% United States Treasury Note/Bond 30/11/2025      | 2 171 006        | 0,44              |
| 1 413 000 2.875% United States Treasury Note/Bond 30/04/2025      | 1 379 552        | 0,28              | 1 044 000 2.875% United States Treasury Note/Bond 30/11/2025      | 1 017 411        | 0,21              |
| 2 901 000 2.125% United States Treasury Note/Bond 15/05/2025      | 2 789 040        | 0,57              | 1 439 000 4.000% United States Treasury Note/Bond 15/12/2025      | 1 444 509        | 0,30              |
| 2 566 000 2.750% United States Treasury Note/Bond 15/05/2025      | 2 499 043        | 0,51              | 2 682 000 0.375% United States Treasury Note/Bond 31/12/2025      | 2 444 601        | 0,50              |
| 2 208 000 0.250% United States Treasury Note/Bond 31/05/2025      | 2 037 570        | 0,42              | 960 000 2.625% United States Treasury Note/Bond 31/12/2025        | 928 950          | 0,19              |
| 1 125 000 2.875% United States Treasury Note/Bond 31/05/2025      | 1 098 193        | 0,22              | 839 000 3.875% United States Treasury Note/Bond 15/01/2026        | 839 328          | 0,17              |
| 2 078 000 2.875% United States Treasury Note/Bond 15/06/2025      | 2 029 135        | 0,42              | 2 899 000 0.375% United States Treasury Note/Bond 31/01/2026      | 2 631 748        | 0,54              |
| 2 165 000 0.250% United States Treasury Note/Bond 30/06/2025      | 1 995 521        | 0,41              | 1 351 000 2.625% United States Treasury Note/Bond 31/01/2026      | 1 306 881        | 0,27              |
| 876 000 2.750% United States Treasury Note/Bond 30/06/2025        | 852 457          | 0,17              | 2 409 000 1.625% United States Treasury Note/Bond 15/02/2026      | 2 265 589        | 0,46              |
| 2 122 000 3.000% United States Treasury Note/Bond 15/07/2025      | 2 076 576        | 0,42              | 285 000 6.000% United States Treasury Note/Bond 15/02/2026        | 300 786          | 0,06              |
| 2 260 000 0.250% United States Treasury Note/Bond 31/07/2025      | 2 075 316        | 0,42              | 2 938 000 0.500% United States Treasury Note/Bond 28/02/2026      | 2 670 137        | 0,55              |
| 1 005 000 2.875% United States Treasury Note/Bond 31/07/2025      | 981 367          | 0,20              | 1 241 000 2.500% United States Treasury Note/Bond 28/02/2026      | 1 195 626        | 0,24              |
| 2 613 000 2.000% United States Treasury Note/Bond 15/08/2025      | 2 500 314        | 0,51              | 2 000 000 4.625% United States Treasury Note/Bond 15/03/2026      | 2 044 922        | 0,42              |
| 2 073 000 3.125% United States Treasury Note/Bond 15/08/2025      | 2 034 131        | 0,42              | 2 715 000 0.750% United States Treasury Note/Bond 31/03/2026      | 2 484 225        | 0,51              |
| 200 000 6.875% United States Treasury Note/Bond 15/08/2025        | 212 859          | 0,04              | 1 210 000 2.250% United States Treasury Note/Bond 31/03/2026      | 1 157 252        | 0,24              |
| 2 214 000 0.250% United States Treasury Note/Bond 31/08/2025      | 2 028 232        | 0,41              | 2 724 000 0.750% United States Treasury Note/Bond 30/04/2026      | 2 483 522        | 0,51              |
| 1 034 000 2.750% United States Treasury Note/Bond 31/08/2025      | 1 005 484        | 0,21              | 936 000 2.375% United States Treasury Note/Bond 30/04/2026        | 897 829          | 0,18              |
| 1 800 000 3.500% United States Treasury Note/Bond 15/09/2025      | 1 782 844        | 0,36              | 2 466 000 1.625% United States Treasury Note/Bond 15/05/2026      | 2 308 600        | 0,47              |
| 2 700 000 0.250% United States Treasury Note/Bond 30/09/2025      | 2 470 922        | 0,51              | 2 838 000 0.750% United States Treasury Note/Bond 31/05/2026      | 2 581 471        | 0,53              |
| 1 119 000 3.000% United States Treasury Note/Bond 30/09/2025      | 1 094 347        | 0,22              | 1 203 000 2.125% United States Treasury Note/Bond 31/05/2026      | 1 143 320        | 0,23              |
| 739 000 4.250% United States Treasury Note/Bond 15/10/2025        | 744 831          | 0,15              | 2 534 000 0.875% United States Treasury Note/Bond 30/06/2026      | 2 310 889        | 0,47              |
| 2 805 000 0.250% United States Treasury Note/Bond 31/10/2025      | 2 557 590        | 0,52              | 1 180 000 1.875% United States Treasury Note/Bond 30/06/2026      | 1 111 689        | 0,23              |
| 822 000 3.000% United States Treasury Note/Bond 31/10/2025        | 803 762          | 0,16              | 2 771 000 0.625% United States Treasury Note/Bond 31/07/2026      | 2 499 529        | 0,51              |

## SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD                                   | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets                                  |           |      |
|---|--|-------------------|---|------------------|--|-----------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %) (suite)</b> |  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %) (suite)</b> |                  |  |           |      |
| <b>Obligations d'État – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %) (suite)</b> |  |                   | <b>Obligations d'État – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %) (suite)</b> |                  |  |           |      |
| <b>Dollar américain – 99,33 % (suite)</b>                         |  |                   | <b>Dollar américain – 99,33 % (suite)</b>                         |                  |  |           |      |
| 1 142 000   | 1.875% United States Treasury Note/Bond 31/07/2026 | 1 074 283         | 0,22  | 2 188 000        | 2.625% United States Treasury Note/Bond 31/05/2027 | 2 098 087 | 0,43 |
| 2 651 000   | 1.500% United States Treasury Note/Bond 15/08/2026 | 2 461 081         | 0,50  | 1 708 000        | 0.500% United States Treasury Note/Bond 30/06/2027 | 1 496 101 | 0,31 |
| 2 924 000   | 0.750% United States Treasury Note/Bond 31/08/2026 | 2 643 022         | 0,54  | 2 239 000        | 3.250% United States Treasury Note/Bond 30/06/2027 | 2 200 692 | 0,45 |
| 1 180 000   | 1.375% United States Treasury Note/Bond 31/08/2026 | 1 089 472         | 0,22  | 1 685 000        | 0.375% United States Treasury Note/Bond 31/07/2027 | 1 463 712 | 0,30 |
| 2 745 000   | 0.875% United States Treasury Note/Bond 30/09/2026 | 2 486 584         | 0,51  | 2 150 000        | 2.750% United States Treasury Note/Bond 31/07/2027 | 2 070 551 | 0,42 |
| 898 000   | 1.625% United States Treasury Note/Bond 30/09/2026 | 835 912           | 0,17  | 2 110 000        | 2.250% United States Treasury Note/Bond 15/08/2027 | 1 990 818 | 0,41 |
| 2 722 000   | 1.125% United States Treasury Note/Bond 31/10/2026 | 2 483 187         | 0,51  | 200 000          | 6.375% United States Treasury Note/Bond 15/08/2027 | 221 172   | 0,05 |
| 1 175 000   | 1.625% United States Treasury Note/Bond 31/10/2026 | 1 091 832         | 0,22  | 1 747 000        | 0.500% United States Treasury Note/Bond 31/08/2027 | 1 522 756 | 0,31 |
| 2 563 000   | 2.000% United States Treasury Note/Bond 15/11/2026 | 2 410 622         | 0,49  | 2 088 000        | 3.125% United States Treasury Note/Bond 31/08/2027 | 2 042 651 | 0,42 |
| 160 000   | 6.500% United States Treasury Note/Bond 15/11/2026 | 174 475           | 0,04  | 2 240 000        | 0.375% United States Treasury Note/Bond 30/09/2027 | 1 936 725 | 0,40 |
| 2 960 000   | 1.250% United States Treasury Note/Bond 30/11/2026 | 2 707 937         | 0,55  | 2 003 000        | 4.125% United States Treasury Note/Bond 30/09/2027 | 2 041 026 | 0,42 |
| 1 067 000   | 6.000% United States Treasury Note/Bond 30/11/2026 | 990 226           | 0,20  | 2 139 000        | 0.500% United States Treasury Note/Bond 31/10/2027 | 1 856 251 | 0,38 |
| 2 657 000   | 1.250% United States Treasury Note/Bond 31/12/2026 | 2 427 419         | 0,50  | 1 995 000        | 4.125% United States Treasury Note/Bond 31/10/2027 | 2 033 653 | 0,42 |
| 1 205 000   | 1.750% United States Treasury Note/Bond 31/12/2026 | 1 122 156         | 0,23  | 2 119 000        | 2.250% United States Treasury Note/Bond 15/11/2027 | 1 993 681 | 0,41 |
| 3 562 000   | 1.500% United States Treasury Note/Bond 31/01/2027 | 3 279 545         | 0,67  | 500 000          | 6.125% United States Treasury Note/Bond 15/11/2027 | 551 914   | 0,11 |
| 2 204 000   | 2.250% United States Treasury Note/Bond 15/02/2027 | 2 088 290         | 0,43  | 2 327 000        | 0.625% United States Treasury Note/Bond 30/11/2027 | 2 028 490 | 0,42 |
| 114 000   | 6.625% United States Treasury Note/Bond 15/02/2027 | 125 774           | 0,03  | 2 005 000        | 3.875% United States Treasury Note/Bond 30/11/2027 | 2 026 146 | 0,41 |
| 685 000   | 1.125% United States Treasury Note/Bond 28/02/2027 | 621 745           | 0,13  | 2 519 000        | 0.625% United States Treasury Note/Bond 31/12/2027 | 2 190 940 | 0,45 |
| 2 560 000   | 1.875% United States Treasury Note/Bond 28/02/2027 | 2 389 000         | 0,49  | 1 993 000        | 3.875% United States Treasury Note/Bond 31/12/2027 | 2 014 176 | 0,41 |
| 1 152 000   | 0.625% United States Treasury Note/Bond 31/03/2027 | 1 021 680         | 0,21  | 2 193 000        | 0.750% United States Treasury Note/Bond 31/01/2028 | 1 915 620 | 0,39 |
| 2 404 000   | 2.500% United States Treasury Note/Bond 31/03/2027 | 2 296 196         | 0,47  | 1 826 000        | 3.500% United States Treasury Note/Bond 31/01/2028 | 1 816 727 | 0,37 |
| 1 479 000   | 0.500% United States Treasury Note/Bond 30/04/2027 | 1 302 444         | 0,27  | 2 235 000        | 2.750% United States Treasury Note/Bond 15/02/2028 | 2 146 822 | 0,44 |
| 2 346 000   | 2.750% United States Treasury Note/Bond 30/04/2027 | 2 261 141         | 0,46  | 2 884 000        | 1.125% United States Treasury Note/Bond 29/02/2028 | 2 560 677 | 0,52 |
| 1 999 000   | 2.375% United States Treasury Note/Bond 15/05/2027 | 1 898 738         | 0,39  | 1 539 000        | 4.000% United States Treasury Note/Bond 29/02/2028 | 1 567 112 | 0,32 |
| 1 427 000   | 0.500% United States Treasury Note/Bond 31/05/2027 | 1 252 304         | 0,26  | 1 904 000        | 1.250% United States Treasury Note/Bond 31/03/2028 | 1 698 427 | 0,35 |

## SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD                                   | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets                                  |           |      |
|---|--|-------------------|---|------------------|--|-----------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %) (suite)</b> |  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %) (suite)</b> |                  |  |           |      |
| <b>Obligations d'État – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %) (suite)</b> |  |                   | <b>Obligations d'État – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %) (suite)</b> |                  |  |           |      |
| <b>Dollar américain – 99,33 % (suite)</b>                         |  |                   | <b>Dollar américain – 99,33 % (suite)</b>                         |                  |  |           |      |
| 2 000 000   | 3.625% United States Treasury Note/Bond 31/03/2028 | 2 003 750         | 0,41  | 2 432 000        | 1.625% United States Treasury Note/Bond 15/08/2029 | 2 169 800 | 0,44 |
| 2 771 000   | 1.250% United States Treasury Note/Bond 30/04/2028 | 2 467 272         | 0,50  | 200 000          | 6.125% United States Treasury Note/Bond 15/08/2029 | 228 219   | 0,05 |
| 3 260 000   | 2.875% United States Treasury Note/Bond 15/05/2028 | 3 144 881         | 0,64  | 1 904 000        | 3.125% United States Treasury Note/Bond 31/08/2029 | 1 853 574 | 0,38 |
| 2 842 000   | 1.250% United States Treasury Note/Bond 31/05/2028 | 2 527 160         | 0,52  | 1 800 000        | 3.875% United States Treasury Note/Bond 30/09/2029 | 1 829 812 | 0,37 |
| 2 637 000   | 1.250% United States Treasury Note/Bond 30/06/2028 | 2 340 750         | 0,48  | 2 200 000        | 4.000% United States Treasury Note/Bond 31/10/2029 | 2 253 281 | 0,46 |
| 2 801 000   | 1.000% United States Treasury Note/Bond 31/07/2028 | 2 448 249         | 0,50  | 1 806 000        | 1.750% United States Treasury Note/Bond 15/11/2029 | 1 622 014 | 0,33 |
| 2 922 000   | 2.875% United States Treasury Note/Bond 15/08/2028 | 2 814 480         | 0,58  | 2 500 000        | 3.875% United States Treasury Note/Bond 30/11/2029 | 2 543 359 | 0,52 |
| 332 000   | 5.500% United States Treasury Note/Bond 15/08/2028 | 361 206           | 0,07  | 2 000 000        | 3.875% United States Treasury Note/Bond 31/12/2029 | 2 036 250 | 0,42 |
| 2 904 000   | 1.125% United States Treasury Note/Bond 31/08/2028 | 2 550 302         | 0,52  | 1 950 000        | 3.500% United States Treasury Note/Bond 31/01/2030 | 1 942 383 | 0,40 |
| 2 576 000   | 1.250% United States Treasury Note/Bond 30/09/2028 | 2 272 917         | 0,46  | 2 857 000        | 1.500% United States Treasury Note/Bond 15/02/2030 | 2 504 785 | 0,51 |
| 2 688 000   | 1.375% United States Treasury Note/Bond 31/10/2028 | 2 385 180         | 0,49  | 1 926 000        | 4.000% United States Treasury Note/Bond 28/02/2030 | 1 977 460 | 0,40 |
| 2 831 000   | 3.125% United States Treasury Note/Bond 15/11/2028 | 2 759 783         | 0,56  | 4 206 000        | 0.625% United States Treasury Note/Bond 15/05/2030 | 3 443 005 | 0,70 |
| 400 000   | 5.250% United States Treasury Note/Bond 15/11/2028 | 432 406           | 0,09  | 370 000          | 6.250% United States Treasury Note/Bond 15/05/2030 | 431 917   | 0,09 |
| 2 752 000   | 1.500% United States Treasury Note/Bond 30/11/2028 | 2 455 085         | 0,50  | 5 057 000        | 0.625% United States Treasury Note/Bond 15/08/2030 | 4 121 455 | 0,84 |
| 2 463 000   | 1.375% United States Treasury Note/Bond 31/12/2028 | 2 181 679         | 0,45  | 5 015 000        | 0.875% United States Treasury Note/Bond 15/11/2030 | 4 151 480 | 0,85 |
| 2 660 000   | 1.750% United States Treasury Note/Bond 31/01/2029 | 2 401 689         | 0,49  | 5 016 000        | 1.125% United States Treasury Note/Bond 15/02/2031 | 4 223 629 | 0,86 |
| 2 854 000   | 2.625% United States Treasury Note/Bond 15/02/2029 | 2 706 395         | 0,55  | 474 000          | 5.375% United States Treasury Note/Bond 15/02/2031 | 532 213   | 0,11 |
| 299 000   | 5.250% United States Treasury Note/Bond 15/02/2029 | 323 995           | 0,07  | 4 978 000        | 1.625% United States Treasury Note/Bond 15/05/2031 | 4 326 971 | 0,89 |
| 2 350 000   | 1.875% United States Treasury Note/Bond 28/02/2029 | 2 135 012         | 0,44  | 5 361 000        | 1.250% United States Treasury Note/Bond 15/08/2031 | 4 496 539 | 0,92 |
| 2 350 000   | 2.375% United States Treasury Note/Bond 31/03/2029 | 2 193 945         | 0,45  | 5 333 000        | 1.375% United States Treasury Note/Bond 15/11/2031 | 4 501 385 | 0,92 |
| 2 017 000   | 2.875% United States Treasury Note/Bond 30/04/2029 | 1 936 635         | 0,40  | 4 952 000        | 1.875% United States Treasury Note/Bond 15/02/2032 | 4 346 927 | 0,89 |
| 2 491 000   | 2.375% United States Treasury Note/Bond 15/05/2029 | 2 324 220         | 0,48  | 4 880 000        | 2.875% United States Treasury Note/Bond 15/05/2032 | 4 644 387 | 0,95 |
| 2 250 000   | 2.750% United States Treasury Note/Bond 31/05/2029 | 2 144 531         | 0,44  | 4 571 000        | 2.750% United States Treasury Note/Bond 15/08/2032 | 4 301 740 | 0,88 |
| 2 100 000   | 3.250% United States Treasury Note/Bond 30/06/2029 | 2 058 984         | 0,42  | 4 720 000        | 4.125% United States Treasury Note/Bond 15/11/2032 | 4 960 425 | 1,01 |
| 1 800 000   | 2.625% United States Treasury Note/Bond 31/07/2029 | 1 702 406         | 0,35  | 2 326 000        | 3.500% United States Treasury Note/Bond 15/02/2033 | 2 330 998 | 0,48 |

## SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Obligations d'État – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'État – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 99,33 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 99,33 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 460 000 4.500% United States Treasury Note/Bond 15/02/2036        | 511 031          | 0,10              | 710 000 3.125% United States Treasury Note/Bond 15/02/2042        | 643 992          | 0,13              |
| 250 000 4.750% United States Treasury Note/Bond 15/02/2037        | 284 922          | 0,06              | 693 000 3.000% United States Treasury Note/Bond 15/05/2042        | 614 929          | 0,13              |
| 300 000 5.000% United States Treasury Note/Bond 15/05/2037        | 349 687          | 0,07              | 2 111 000 3.250% United States Treasury Note/Bond 15/05/2042      | 1 947 727        | 0,40              |
| 300 000 4.375% United States Treasury Note/Bond 15/02/2038        | 328 406          | 0,07              | 724 000 2.750% United States Treasury Note/Bond 15/08/2042        | 615 513          | 0,13              |
| 400 000 4.500% United States Treasury Note/Bond 15/05/2038        | 443 250          | 0,09              | 1 846 000 3.375% United States Treasury Note/Bond 15/08/2042      | 1 733 798        | 0,35              |
| 213 000 3.500% United States Treasury Note/Bond 15/02/2039        | 210 437          | 0,04              | 1 016 000 2.750% United States Treasury Note/Bond 15/11/2042      | 861 060          | 0,18              |
| 561 000 4.250% United States Treasury Note/Bond 15/05/2039        | 605 091          | 0,12              | 2 228 000 4.000% United States Treasury Note/Bond 15/11/2042      | 2 288 574        | 0,47              |
| 472 000 4.500% United States Treasury Note/Bond 15/08/2039        | 523 699          | 0,11              | 909 000 3.125% United States Treasury Note/Bond 15/02/2043        | 816 822          | 0,17              |
| 615 000 4.375% United States Treasury Note/Bond 15/11/2039        | 671 407          | 0,14              | 1 000 000 3.875% United States Treasury Note/Bond 15/02/2043      | 1 009 445        | 0,21              |
| 606 000 4.625% United States Treasury Note/Bond 15/02/2040        | 681 371          | 0,14              | 1 383 000 2.875% United States Treasury Note/Bond 15/05/2043      | 1 193 702        | 0,24              |
| 1 839 000 1.125% United States Treasury Note/Bond 15/05/2040      | 1 223 797        | 0,25              | 1 045 000 3.625% United States Treasury Note/Bond 15/08/2043      | 1 013 813        | 0,21              |
| 564 000 4.375% United States Treasury Note/Bond 15/05/2040        | 615 024          | 0,13              | 1 091 000 3.750% United States Treasury Note/Bond 15/11/2043      | 1 076 851        | 0,22              |
| 2 251 000 1.125% United States Treasury Note/Bond 15/08/2040      | 1 487 419        | 0,30              | 1 094 000 3.625% United States Treasury Note/Bond 15/02/2044      | 1 057 761        | 0,22              |
| 567 000 3.875% United States Treasury Note/Bond 15/08/2040        | 581 086          | 0,12              | 1 004 000 3.375% United States Treasury Note/Bond 15/05/2044      | 933 563          | 0,19              |
| 2 108 000 1.375% United States Treasury Note/Bond 15/11/2040      | 1 450 567        | 0,30              | 1 331 000 3.125% United States Treasury Note/Bond 15/08/2044      | 1 187 294        | 0,24              |
| 674 000 4.250% United States Treasury Note/Bond 15/11/2040        | 723 076          | 0,15              | 1 161 000 3.000% United States Treasury Note/Bond 15/11/2044      | 1 012 610        | 0,21              |
| 2 725 000 1.875% United States Treasury Note/Bond 15/02/2041      | 2 038 641        | 0,42              | 1 641 000 2.500% United States Treasury Note/Bond 15/02/2045      | 1 308 954        | 0,27              |
| 649 000 4.750% United States Treasury Note/Bond 15/02/2041        | 739 049          | 0,15              | 777 000 3.000% United States Treasury Note/Bond 15/05/2045        | 676 476          | 0,14              |
| 2 642 000 2.250% United States Treasury Note/Bond 15/05/2041      | 2 098 326        | 0,43              | 1 058 500 2.875% United States Treasury Note/Bond 15/08/2045      | 901 710          | 0,18              |
| 576 000 4.375% United States Treasury Note/Bond 15/05/2041        | 626 490          | 0,13              | 674 000 3.000% United States Treasury Note/Bond 15/11/2045        | 586 275          | 0,12              |
| 3 515 000 1.750% United States Treasury Note/Bond 15/08/2041      | 2 544 530        | 0,52              | 1 358 000 2.500% United States Treasury Note/Bond 15/02/2046      | 1 078 337        | 0,22              |
| 581 000 3.750% United States Treasury Note/Bond 15/08/2041        | 579 820          | 0,12              | 1 301 000 2.500% United States Treasury Note/Bond 15/05/2046      | 1 032 465        | 0,21              |
| 2 939 000 2.000% United States Treasury Note/Bond 15/11/2041      | 2 217 108        | 0,45              | 1 547 000 2.250% United States Treasury Note/Bond 15/08/2046      | 1 166 776        | 0,24              |
| 668 000 3.125% United States Treasury Note/Bond 15/11/2041        | 608 715          | 0,12              | 762 000 2.875% United States Treasury Note/Bond 15/11/2046        | 649 129          | 0,13              |
| 2 373 000 2.375% United States Treasury Note/Bond 15/02/2042      | 1 907 670        | 0,39              | 1 360 000 3.000% United States Treasury Note/Bond 15/02/2047      | 1 183 200        | 0,24              |

## SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|---|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Obligations d'État – 99,33 % (mars 2022 : 99,46 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Dollar américain – 99,33 % (suite)</b>                         |                    |                   |
| 1 047 000 3.000% United States Treasury Note/Bond 15/05/2047      | 911 054            | 0,19              |
| 1 497 000 2.750% United States Treasury Note/Bond 15/08/2047      | 1 244 381          | 0,25              |
| 1 608 000 2.750% United States Treasury Note/Bond 15/11/2047      | 1 337 906          | 0,27              |
| 1 729 000 3.000% United States Treasury Note/Bond 15/02/2048      | 1 508 012          | 0,31              |
| 1 880 000 3.125% United States Treasury Note/Bond 15/05/2048      | 1 678 194          | 0,34              |
| 2 107 000 3.000% United States Treasury Note/Bond 15/08/2048      | 1 839 345          | 0,38              |
| 2 163 000 3.375% United States Treasury Note/Bond 15/11/2048      | 2 023 419          | 0,41              |
| 2 238 000 3.000% United States Treasury Note/Bond 15/02/2049      | 1 958 949          | 0,40              |
| 2 195 000 2.875% United States Treasury Note/Bond 15/05/2049      | 1 877 754          | 0,38              |
| 2 034 000 2.250% United States Treasury Note/Bond 15/08/2049      | 1 528 996          | 0,31              |
| 1 935 000 2.375% United States Treasury Note/Bond 15/11/2049      | 1 495 090          | 0,31              |
| 2 442 000 2.000% United States Treasury Note/Bond 15/02/2050      | 1 730 767          | 0,35              |
| 2 883 000 1.250% United States Treasury Note/Bond 15/05/2050      | 1 676 645          | 0,34              |
| 3 264 000 1.375% United States Treasury Note/Bond 15/08/2050      | 1 960 950          | 0,40              |
| 3 128 000 1.625% United States Treasury Note/Bond 15/11/2050      | 2 007 296          | 0,41              |
| 3 383 000 1.875% United States Treasury Note/Bond 15/02/2051      | 2 311 540          | 0,47              |
| 3 330 000 2.375% United States Treasury Note/Bond 15/05/2051      | 2 556 816          | 0,52              |
| 3 541 000 2.000% United States Treasury Note/Bond 15/08/2051      | 2 490 872          | 0,51              |
| 3 244 000 1.875% United States Treasury Note/Bond 15/11/2051      | 2 208 961          | 0,45              |
| 3 028 000 2.250% United States Treasury Note/Bond 15/02/2052      | 2 259 172          | 0,46              |
| 2 798 000 2.875% United States Treasury Note/Bond 15/05/2052      | 2 394 476          | 0,49              |
| 2 810 000 3.000% United States Treasury Note/Bond 15/08/2052      | 2 469 287          | 0,51              |
| 2 711 000 4.000% United States Treasury Note/Bond 15/11/2052      | 2 878 320          | 0,59              |
| 1 280 000 3.625% United States Treasury Note/Bond 15/02/2053      | 1 271 801          | 0,26              |
| <b>Total des obligations d'État</b>                               | <b>485 619 522</b> | <b>99,33</b>      |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>                               | <b>485 619 522</b> | <b>99,33</b>      |

|   | Juste valeur USD   | % du Comp.    |
|---|--------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | <b>485 619 522</b> | <b>99,33</b>  |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,16 %)</b>                               | <b>1 526 406</b>   | <b>0,31</b>   |
| <b>Liquidités détenues auprès d'un courtier (mars 2022 : néant)</b>                 | <b>111</b>         | <b>0,00</b>   |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : 0,38 %)</b>                                      | <b>1 744 500</b>   | <b>0,36</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>488 890 539</b> | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

|   | % du total des actifs |
|---|-----------------------|
| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                        |                       |
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs | 87,65                 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé             | 10,27                 |
| Autres actifs   | 2,08                  |
| <b>Total des actifs</b>   | <b>100,00</b>         |

## SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD       | 2022*<br>USD       |
|---|-------|-------------------|--------------------|
| <b>Actifs circulants</b>  |       |                   |                    |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :            |       |                   |                    |
|   | 1(e)  |                   |                    |
| Valeurs mobilières  |       | 19 550 072        | 29 743 630         |
|   |       | <b>19 550 072</b> | <b>29 743 630</b>  |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie   |       |                   |                    |
|   | 1(f)  | 86 835            | 159 266            |
| Créances :  |       |                   |                    |
| Intérêts à recevoir   |       | 252 891           | 484 903            |
| À recevoir sur cessions d'investissements   |       | 291 211           | 4 891 025          |
|   |       | <b>20 181 009</b> | <b>35 278 824</b>  |
| <b>Total des actifs circulants</b>  |       |                   |                    |
| <b>Passifs circulants</b>   |       |                   |                    |
| Découverts bancaires  | 1(f)  | (4 679)           | -                  |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :  |       |                   |                    |
| Charges à payer   |       | (3 167)           | (5 715)            |
| À payer sur achats d'investissements  |       | (333 500)         | -                  |
| À payer sur rachats d'actions de fonds  |       | -                 | (5 065 191)        |
|   |       | <b>(341 346)</b>  | <b>(5 070 906)</b> |
| <b>Total des passifs circulants</b>   |       |                   |                    |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> |       |                   |                    |
|   |       | <b>19 839 663</b> | <b>30 207 918</b>  |
|   |       | <b>2023</b>       | <b>2022*</b>       |
| Valeur liquidative par action   |       |                   |                    |
|   | 5     | 29,22 USD         | 30,69 USD          |

\* Le Compartiment a été lancé le 10 novembre 2021.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.



## SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD        | 2022*<br>USD   |
|--|-------|--------------------|----------------|
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur   |       | 574 957            | 239 453        |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat                 | 9     | (1 703 792)        | 66 990         |
| Produits divers  |       | 113                | -              |
| <b>Total des (charges)/revenus d'investissement</b>  |       | <b>(1 128 722)</b> | <b>306 443</b> |
| Charges opérationnelles  | 3     | (40 747)           | (17 096)       |
| <b>(Perte)/Bénéfice net(te) pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(1 169 469)</b> | <b>289 347</b> |
| <b>Charges financières</b>   |       |                    |                |
| Charges d'intérêts   |       | -                  | (2)            |
| <b>(Perte)/Bénéfice pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(1 169 469)</b> | <b>289 345</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement  | 2     | (5)                | -              |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(1 169 474)</b> | <b>289 345</b> |

\* Le Compartiment a été lancé le 10 novembre 2021.

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | 2023<br>USD         | 2022*<br>USD      |
|--|---------------------|-------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables en début d'exercice financier/de période financière           | 30 207 918          | -                 |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(1 169 474)</b>  | <b>289 345</b>    |
| <b>Opérations sur actions</b>  |                     |                   |
| Produits sur actions de participation rachetables émises   | 2 398 399           | 35 752 240        |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables   | (11 597 180)        | (5 833 667)       |
| (Diminution)/Augmentation des actifs nets résultant d'opérations sur actions   | (9 198 781)         | 29 918 573        |
| <b>(Diminution)/Augmentation totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                   | <b>(10 368 255)</b> | <b>30 207 918</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier/la période financière</b> | <b>19 839 663</b>   | <b>30 207 918</b> |

\* Le Compartiment a été lancé le 10 novembre 2021.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

| Notes  | 2023<br>USD         | 2022*<br>USD        |
|--|---------------------|---------------------|
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(1 169 474)</b>  | <b>289 345</b>      |
| <b>Ajustement pour :</b>   |                     |                     |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat   | 15 126 872          | (34 634 655)        |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>  | <b>13 957 398</b>   | <b>(34 345 310)</b> |
| Variation des montants à recevoir  | 232 012             | (484 903)           |
| Variation des montants à payer   | (2 548)             | 5 715               |
| <b>Entrées/(Sorties) de trésorerie sur opérations</b>  | <b>229 464</b>      | <b>(479 188)</b>    |
| <b>Entrées/(Sorties) de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>   | <b>14 186 862</b>   | <b>(34 824 498)</b> |
| <b>Activités de financement</b>  |                     |                     |
| Produits des souscriptions   | 5 2 398 399         | 35 752 240          |
| Paiements sur rachats  | 5 (16 662 371)      | (768 476)           |
| <b>Trésorerie nette (utilisée)/générée sur activités de financement</b>  | <b>(14 263 972)</b> | <b>34 983 764</b>   |
| <b>(Diminution)/Augmentation nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>   | <b>(77 110)</b>     | <b>159 266</b>      |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier   | 159 266             | -                   |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>  | <b>82 156</b>       | <b>159 266</b>      |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie – État de la situation financière  | 86 835              | 159 266             |
| Découverts bancaires – État de la situation financière   | (4 679)             | -                   |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie – État des flux de trésorerie</b>   | <b>82 156</b>       | <b>159 266</b>      |
| <b>Informations supplémentaires</b>  |                     |                     |
| Impôts payés   | (5)                 | -                   |
| Intérêts reçus   | 862 262             | 135 919             |
| Intérêts payés   | -                   | (2)                 |

\* Le Compartiment a été lancé le 10 novembre 2021.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                              | Juste valeur USD                           | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets                          |         |      |
|---|--|-------------------|---|------------------|--|---------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,54 % (mars 2022 : 98,46 %)</b> |  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,54 % (mars 2022 : 98,46 %)</b>         |                  |  |         |      |
| <b>Obligations d'État – 98,54 % (mars 2022 : 98,46 %)</b> |  |                   | <b>(suite)</b>  |                  |  |         |      |
| <b>Yuan Renminbi – 98,54 %</b>                            |  |                   | <b>Obligations d'État – 98,54 % (mars 2022 : 98,46 %) (suite)</b> |                  |  |         |      |
| <b>Yuan Renminbi – 98,54 % (suite)</b>                    |  |                   | <b>Yuan Renminbi – 98,54 % (suite)</b>                            |                  |  |         |      |
| 7 300 000   | 2.840% China Government Bond<br>08/04/2024 | 1 068 902         | 5,39  | 3 000 000        | 3.250% China Government Bond<br>22/11/2028 | 450 346 | 2,27 |
| 1 000 000   | 2.180% China Government Bond<br>25/06/2024 | 145 272           | 0,73  | 1 600 000        | 2.800% China Government Bond<br>24/03/2029 | 232 936 | 1,17 |
| 4 400 000   | 2.470% China Government Bond<br>02/09/2024 | 641 331           | 3,23  | 3 000 000        | 3.290% China Government Bond<br>23/05/2029 | 452 442 | 2,28 |
| 500 000   | 1.990% China Government Bond<br>15/09/2024 | 72 432            | 0,37  | 2 000 000        | 2.750% China Government Bond<br>15/06/2029 | 290 038 | 1,46 |
| 2 500 000   | 2.940% China Government Bond<br>17/10/2024 | 367 205           | 1,85  | 2 000 000        | 2.620% China Government Bond<br>25/09/2029 | 287 480 | 1,45 |
| 200 000   | 2.290% China Government Bond<br>25/12/2024 | 29 068            | 0,15  | 3 400 000        | 3.130% China Government Bond<br>21/11/2029 | 505 425 | 2,55 |
| 2 300 000   | 2.260% China Government Bond<br>24/02/2025 | 333 735           | 1,68  | 100 000          | 2.790% China Government Bond<br>15/12/2029 | 14 523  | 0,07 |
| 6 900 000   | 1.990% China Government Bond<br>09/04/2025 | 995 029           | 5,02  | 3 100 000        | 2.680% China Government Bond<br>21/05/2030 | 446 158 | 2,25 |
| 1 600 000   | 2.240% China Government Bond<br>25/05/2025 | 231 810           | 1,17  | 4 200 000        | 3.270% China Government Bond<br>19/11/2030 | 633 174 | 3,19 |
| 2 300 000   | 2.180% China Government Bond<br>25/08/2025 | 332 383           | 1,68  | 5 100 000        | 3.020% China Government Bond<br>27/05/2031 | 752 734 | 3,79 |
| 7 600 000   | 3.020% China Government Bond<br>22/10/2025 | 1 121 920         | 5,65  | 3 600 000        | 2.890% China Government Bond<br>18/11/2031 | 524 893 | 2,65 |
| 1 400 000   | 2.280% China Government Bond<br>25/11/2025 | 202 628           | 1,02  | 1 900 000        | 2.750% China Government Bond<br>17/02/2032 | 273 869 | 1,38 |
| 200 000   | 2.460% China Government Bond<br>15/02/2026 | 29 071            | 0,15  | 2 400 000        | 2.760% China Government Bond<br>15/05/2032 | 346 125 | 1,74 |
| 3 800 000   | 3.030% China Government Bond<br>11/03/2026 | 561 662           | 2,83  | 1 300 000        | 2.690% China Government Bond<br>15/08/2032 | 186 296 | 0,94 |
| 3 300 000   | 3.250% China Government Bond<br>06/06/2026 | 491 784           | 2,48  | 1 700 000        | 2.600% China Government Bond<br>01/09/2032 | 241 800 | 1,22 |
| 4 100 000   | 2.690% China Government Bond<br>12/08/2026 | 598 761           | 3,02  | 1 900 000        | 2.800% China Government Bond<br>15/11/2032 | 274 701 | 1,38 |
| 3 100 000   | 3.120% China Government Bond<br>05/12/2026 | 460 030           | 2,32  | 2 500 000        | 4.080% China Government Bond<br>22/10/2048 | 416 234 | 2,10 |
| 2 000 000   | 2.370% China Government Bond<br>20/01/2027 | 288 522           | 1,45  | 2 200 000        | 3.860% China Government Bond<br>22/07/2049 | 354 265 | 1,79 |
| 400 000   | 2.480% China Government Bond<br>15/04/2027 | 57 877            | 0,29  | 1 500 000        | 3.390% China Government Bond<br>16/03/2050 | 222 848 | 1,12 |
| 4 500 000   | 2.850% China Government Bond<br>04/06/2027 | 659 907           | 3,33  | 3 600 000        | 3.810% China Government Bond<br>14/09/2050 | 576 107 | 2,90 |
| 800 000   | 2.500% China Government Bond<br>25/07/2027 | 115 602           | 0,58  | 1 900 000        | 3.720% China Government Bond<br>12/04/2051 | 299 721 | 1,51 |
| 1 000 000   | 2.440% China Government Bond<br>15/10/2027 | 144 193           | 0,73  | 700 000          | 3.530% China Government Bond<br>18/10/2051 | 107 031 | 0,54 |
| 3 500 000   | 3.280% China Government Bond<br>03/12/2027 | 524 630           | 2,64  | 900 000          | 3.320% China Government Bond<br>15/04/2052 | 133 177 | 0,67 |
| 1 900 000   | 2.640% China Government Bond<br>15/01/2028 | 276 010           | 1,39  | 550 000          | 3.120% China Government Bond<br>25/10/2052 | 78 371  | 0,40 |
| 3 500 000   | 3.010% China Government Bond<br>13/05/2028 | 517 198           | 2,61  | 1 100 000        | 4.000% China Government Bond<br>24/06/2069 | 186 415 | 0,94 |
| 3 000 000   | 2.910% China Government Bond<br>14/10/2028 | 440 602           | 2,22  |                  |  |         |      |

## SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,54 % (mars 2022 : 98,46 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Obligations d'État – 98,54 % (mars 2022 : 98,46 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Yuan Renminbi – 98,54 % (suite)</b>                            |                   |                   |
| 1 800 000 3.730% China Government Bond 25/05/2070                 | 288 598           | 1,45              |
| 1 000 000 3.760% China Government Bond 22/03/2071                 | 162 342           | 0,82              |
| 700 000 3.400% China Government Bond 15/07/2072                   | 104 459           | 0,53              |
| <b>Total des obligations d'État</b>                               | <b>19 550 072</b> | <b>98,54</b>      |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>                               | <b>19 550 072</b> | <b>98,54</b>      |

|   | Juste valeur USD  | % du Comp.    |
|---|-------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | 19 550 072        | 98,54         |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,53 %)</b>                               | 86 835            | 0,44          |
| <b>Découverts bancaires (mars 2022 : néant)</b>                                     | (4 679)           | (0,02)        |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : 1,01 %)</b>                                      | 207 435           | 1,04          |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>19 839 663</b> | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

| Analyse du total des actifs (non auditée)  | % du total des actifs |
|--|-----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs            | 27,50                 |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé                        | 63,99                 |
| Autres valeurs mobilières du type mentionné dans le Règlement 68(1)(a), (b) et (c) | 5,38                  |
| Autres actifs  | 3,13                  |
| <b>Total des actifs</b>  | <b>100,00</b>         |

## SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>EUR        | 2022<br>EUR        |
|---|-------|--------------------|--------------------|
| <b>Actifs circulants</b>  |       |                    |                    |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :            |       |                    |                    |
| Valeurs mobilières  | 1(e)  | 72 328 296         | 69 640 870         |
|   |       | <b>72 328 296</b>  | <b>69 640 870</b>  |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie   | 1(f)  | 147 997            | 662 463            |
| Créances :  |       |                    |                    |
| Intérêts à recevoir   |       | 752 441            | 621 143            |
| À recevoir sur cessions d'investissements   |       | 1 286 919          | 1 798 871          |
| <b>Total des actifs circulants</b>  |       | <b>74 515 653</b>  | <b>72 723 347</b>  |
| <b>Passifs circulants</b>   |       |                    |                    |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :  |       |                    |                    |
| Charges à payer   |       | (9 390)            | (8 845)            |
| À payer sur achats d'investissements  |       | (1 381 212)        | (2 249 076)        |
| <b>Total des passifs circulants</b>   |       | <b>(1 390 602)</b> | <b>(2 257 921)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> |       | <b>73 125 051</b>  | <b>70 465 426</b>  |
|   |       | <b>2023</b>        | <b>2022</b>        |
|   |       | <b>2021</b>        |                    |
| Valeur liquidative par action   | 5     | 26,25 EUR          | 28,46 EUR          |
|   |       |                    | 30,06 EUR          |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>EUR        | 2022<br>EUR        |
|---|-------|--------------------|--------------------|
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 1 016 877          | 536 460            |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 9     | (5 851 403)        | (5 172 030)        |
| Produits divers   |       | 1 434              | 551                |
| <b>Total des charges d'investissement</b>   |       | <b>(4 833 092)</b> | <b>(4 635 019)</b> |
| Charges opérationnelles   | 3     | (94 853)           | (150 666)          |
| <b>Perte nette pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(4 927 945)</b> | <b>(4 785 685)</b> |
| <b>Charges financières</b>  |       |                    |                    |
| Charges d'intérêts  |       | (997)              | (4 156)            |
| <b>Perte pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(4 928 942)</b> | <b>(4 789 841)</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement   | 2     | -                  | (322)              |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(4 928 942)</b> | <b>(4 790 163)</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>EUR        | 2022<br>EUR         |
|---|--------------------|---------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier               | 70 465 426         | 91 089 556          |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(4 928 942)</b> | <b>(4 790 163)</b>  |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                    |                     |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 41 127 693         | 58 562 295          |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (33 539 126)       | (74 396 262)        |
| Augmentation/(Diminution) des actifs nets résultant d'opérations sur actions  | 7 588 567          | (15 833 967)        |
| <b>Augmentation/(Diminution) totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>    | <b>2 659 625</b>   | <b>(20 624 130)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>        | <b>73 125 051</b>  | <b>70 465 426</b>   |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.



## SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>EUR        | 2022<br>EUR         |
|---|-------|--------------------|---------------------|
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(4 928 942)</b> | <b>(4 790 163)</b>  |
| <b>Ajustement pour :</b>  |       |                    |                     |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  |       | (3 043 338)        | 20 468 140          |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   |       | <b>(7 972 280)</b> | <b>15 677 977</b>   |
| Variation des montants à recevoir   |       | (131 298)          | 178 205             |
| Variation des montants à payer  |       | 545                | (2 739)             |
| <b>(Sorties)/Entrées de trésorerie sur opérations</b>   |       | <b>(130 753)</b>   | <b>175 466</b>      |
| <b>(Sorties)/Entrées de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  |       | <b>(8 103 033)</b> | <b>15 853 443</b>   |
| <b>Activités de financement</b>   |       |                    |                     |
| Produits des souscriptions  | 5     | 41 127 693         | 58 562 295          |
| Paiements sur rachats   | 5     | (33 539 126)       | (74 396 262)        |
| <b>Trésorerie nette générée/(utilisée) sur activités de financement</b>   |       | <b>7 588 567</b>   | <b>(15 833 967)</b> |
| <b>(Diminution)/Augmentation nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>                                    |       | <b>(514 466)</b>   | <b>19 476</b>       |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  |       | 662 463            | 642 987             |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   |       | <b>147 997</b>     | <b>662 463</b>      |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |       |                    |                     |
| Impôts payés  |       | -                  | (322)               |
| Intérêts reçus  |       | 1 025 395          | 1 767 048           |
| Intérêts payés  |       | (997)              | (4 156)             |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                                    | Juste valeur EUR                          | % des actifs nets | Participation Investissement                                    | Juste valeur EUR | % des actifs nets                                    |         |      |
|---|---|-------------------|---|------------------|--|---------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %)</b>       |   |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %)</b>       |                  |  |         |      |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %)</b> |   |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %)</b> |                  |  |         |      |
| <b>Euro – 98,91 %</b>   |   |                   | <b>Euro – 98,91 % (suite)</b>                                   |                  |  |         |      |
| 100 000 0.000%  | ABB Finance BV 19/01/2030                 | 79 708            | 0,11  | 220 000 1.625%   | Apple Inc 10/11/2026                                 | 208 745 | 0,29 |
| 100 000 1.500%  | Abbott Ireland Financing DAC 27/09/2026   | 94 034            | 0,13  | 100 000 2.000%   | Apple Inc 17/09/2027                                 | 95 290  | 0,13 |
| 160 000 1.000%  | ABN AMRO Bank NV 16/04/2025               | 152 013           | 0,21  | 100 000 1.375%   | Apple Inc 24/05/2029                                 | 90 246  | 0,12 |
| 100 000 0.500%  | ABN AMRO Bank NV 15/04/2026               | 90 543            | 0,12  | 380 000 0.500%   | Apple Inc 15/11/2031                                 | 304 699 | 0,42 |
| 100 000 0.600%  | ABN AMRO Bank NV 15/01/2027               | 88 124            | 0,12  | 100 000 0.750%   | Arkema SA 03/12/2029                                 | 83 803  | 0,11 |
| 100 000 4.500%  | ABN AMRO Bank NV 21/11/2034               | 100 161           | 0,14  | 200 000 0.875%   | Arval Service Lease SA/France 17/02/2025             | 188 430 | 0,26 |
| 320 000 0.750%  | Acef Holding SCA 14/06/2028               | 239 242           | 0,33  | 100 000 0.155%   | Asahi Group Holdings Ltd 23/10/2024                  | 94 601  | 0,13 |
| 200 000 1.250%  | Acef Holding SCA 26/04/2030               | 136 726           | 0,19  | 160 000 0.250%   | ASB Finance Ltd 08/09/2028                           | 132 482 | 0,18 |
| 300 000 0.625%  | adidas AG 10/09/2035                      | 210 861           | 0,29  | 100 000 0.625%   | ASML Holding NV 07/05/2029                           | 85 156  | 0,12 |
| 100 000 4.000%  | Aegon NV 25/04/2044                       | 98 030            | 0,13  | 30 000 5.000%    | ASR Nederland NV (Perpetual)                         | 29 596  | 0,04 |
| 100 000 1.250%  | Air Liquide Finance SA 03/06/2025         | 97 040            | 0,13  | 530 000 5.125%   | Assicurazioni Generali SpA 16/09/2024                | 541 989 | 0,74 |
| 100 000 0.625%  | Air Liquide Finance SA 20/06/2030         | 84 051            | 0,12  | 300 000 4.125%   | Assicurazioni Generali SpA 04/05/2026                | 297 144 | 0,41 |
| 150 000 0.800%  | Air Products and Chemicals Inc 05/05/2032 | 116 757           | 0,16  | 100 000 5.000%   | Assicurazioni Generali SpA 08/06/2048                | 98 198  | 0,13 |
| 250 000 1.750%  | Akzo Nobel NV 07/11/2024                  | 244 527           | 0,33  | 100 000 4.596%   | Assicurazioni Generali SpA (Perpetual)               | 97 055  | 0,13 |
| 100 000 1.125%  | Akzo Nobel NV 08/04/2026                  | 92 969            | 0,13  | 100 000 0.375%   | AstraZeneca PLC 03/06/2029                           | 83 417  | 0,11 |
| 100 000 1.625%  | Akzo Nobel NV 14/04/2030                  | 85 982            | 0,12  | 100 000 1.800%   | AT&T Inc 05/09/2026                                  | 94 169  | 0,13 |
| 100 000 0.000%  | Allianz Finance II BV 22/11/2026          | 89 679            | 0,12  | 50 000 1.600%    | AT&T Inc 19/05/2028                                  | 45 088  | 0,06 |
| 100 000 3.000%  | Allianz Finance II BV 13/03/2028          | 100 122           | 0,14  | 110 000 2.600%   | AT&T Inc 17/12/2029                                  | 102 256 | 0,14 |
| 100 000 1.500%  | Allianz Finance II BV 15/01/2030          | 89 925            | 0,12  | 100 000 2.050%   | AT&T Inc 19/05/2032                                  | 86 057  | 0,12 |
| 400 000 1.375%  | Allianz Finance II BV 21/04/2031          | 348 092           | 0,48  | 100 000 2.600%   | AT&T Inc 19/05/2038                                  | 80 936  | 0,11 |
| 200 000 2.241%  | Allianz SE 07/07/2045                     | 188 158           | 0,26  | 100 000 1.800%   | AT&T Inc 14/09/2039                                  | 70 183  | 0,10 |
| 100 000 3.099%  | Allianz SE 06/07/2047                     | 93 239            | 0,13  | 100 000 1.125%   | Australia & New Zealand Banking Group Ltd 21/11/2029 | 94 144  | 0,13 |
| 100 000 2.121%  | Allianz SE 08/07/2050                     | 81 562            | 0,11  | 100 000 1.375%   | Autoroutes du Sud de la France SA 22/01/2030         | 87 717  | 0,12 |
| 300 000 3.375%  | Allianz SE (Perpetual)                    | 292 656           | 0,40  | 100 000 3.875%   | Aviva PLC 03/07/2044                                 | 97 590  | 0,13 |
| 100 000 0.500%  | Alstom SA 27/07/2030                      | 79 203            | 0,11  | 170 000 1.125%   | AXA SA 15/05/2028                                    | 152 565 | 0,21 |
| 100 000 2.500%  | Amadeus IT Group SA 20/05/2024            | 98 476            | 0,13  | 130 000 3.750%   | AXA SA 12/10/2030                                    | 130 757 | 0,18 |
| 120 000 1.950%  | American Honda Finance Corp 18/10/2024    | 117 142           | 0,16  | 100 000 1.875%   | AXA SA 10/07/2042                                    | 74 542  | 0,10 |
| 150 000 1.625%  | Anglo American Capital PLC 18/09/2025     | 141 780           | 0,19  | 390 000 3.375%   | AXA SA 06/07/2047                                    | 363 472 | 0,50 |
| 100 000 2.700%  | Anheuser-Busch InBev SA/NV 31/03/2026     | 97 838            | 0,13  | 100 000 3.250%   | AXA SA 28/05/2049                                    | 89 251  | 0,12 |
| 100 000 1.125%  | Anheuser-Busch InBev SA/NV 01/07/2027     | 91 363            | 0,12  | 590 000 3.875%   | AXA SA (Perpetual)                                   | 563 875 | 0,77 |
| 120 000 2.125%  | Anheuser-Busch InBev SA/NV 02/12/2027     | 114 011           | 0,16  | 380 000 3.941%   | AXA SA (Perpetual)                                   | 368 687 | 0,50 |
| 130 000 2.000%  | Anheuser-Busch InBev SA/NV 17/03/2028     | 122 773           | 0,17  | 200 000 0.375%   | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 02/10/2024        | 190 272 | 0,26 |
| 160 000 2.875%  | Anheuser-Busch InBev SA/NV 02/04/2032     | 151 330           | 0,21  | 100 000 1.750%   | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 26/11/2025        | 95 295  | 0,13 |
| 100 000 3.250%  | Anheuser-Busch InBev SA/NV 24/01/2033     | 96 917            | 0,13  | 100 000 0.125%   | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 24/03/2027        | 89 673  | 0,12 |
| 101 000 2.750%  | Anheuser-Busch InBev SA/NV 17/03/2036     | 90 298            | 0,12  | 100 000 0.875%   | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 14/01/2029        | 85 250  | 0,12 |
| 200 000 0.875%  | Apple Inc 24/05/2025                      | 191 006           | 0,26  |                  |  |         |      |

## SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 98,91 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Euro – 98,91 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 2.500% Banco Santander SA 18/03/2025                            | 97 417           | 0,13              | 100 000 6.250% CaixaBank SA 23/02/2033                                  | 101 797          | 0,14              |
| 100 000 1.375% Banco Santander SA 05/01/2026                            | 93 175           | 0,13              | 100 000 1.625% Capgemini SE 15/04/2026                                  | 94 181           | 0,13              |
| 100 000 3.625% Banco Santander SA 27/09/2026                            | 99 167           | 0,14              | 200 000 1.125% Capgemini SE 23/06/2030                                  | 167 484          | 0,23              |
| 100 000 3.125% Banco Santander SA 19/01/2027                            | 95 757           | 0,13              | 600 000 2.375% Capgemini SE 15/04/2032                                  | 532 866          | 0,73              |
| 100 000 3.875% Banco Santander SA 16/01/2028                            | 100 559          | 0,14              | 100 000 0.875% Carlsberg Breweries AS 01/07/2029                        | 85 122           | 0,12              |
| 100 000 2.125% Banco Santander SA 08/02/2028                            | 89 685           | 0,12              | 200 000 2.375% Carrefour SA 30/10/2029                                  | 182 790          | 0,25              |
| 100 000 0.200% Banco Santander SA 11/02/2028                            | 84 147           | 0,12              | 100 000 0.500% CCEP Finance Ireland DAC 06/09/2029                      | 82 082           | 0,11              |
| 100 000 1.000% Banco Santander SA 04/11/2031                            | 78 622           | 0,11              | 100 000 1.500% CCEP Finance Ireland DAC 06/05/2041                      | 66 624           | 0,09              |
| 100 000 3.125% BASF SE 29/06/2028                                       | 98 556           | 0,13              | 200 000 0.500% Ceska sporitelna AS 13/09/2028                           | 159 874          | 0,22              |
| 100 000 3.750% BASF SE 29/06/2032                                       | 100 568          | 0,14              | 100 000 1.000% Cie de Saint-Gobain 17/03/2025                           | 95 670           | 0,13              |
| 100 000 1.300% Baxter International Inc 30/05/2025                      | 94 700           | 0,13              | 100 000 1.375% Cie de Saint-Gobain 14/06/2027                           | 91 933           | 0,13              |
| 100 000 1.213% Becton Dickinson Euro Finance Sarl 12/02/2036            | 70 940           | 0,10              | 100 000 2.625% Cie de Saint-Gobain 10/08/2032                           | 90 730           | 0,12              |
| 100 000 1.500% BHP Billiton Finance Ltd 29/04/2030                      | 85 124           | 0,12              | 100 000 0.875% Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 03/09/2025  | 94 455           | 0,13              |
| 140 000 0.750% BMW Finance NV 15/04/2024                                | 136 758          | 0,19              | 100 000 1.750% Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 03/09/2030  | 91 025           | 0,12              |
| 100 000 0.750% BMW Finance NV 12/07/2024                                | 97 131           | 0,13              | 100 000 2.500% Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 03/09/2038  | 88 923           | 0,12              |
| 100 000 0.750% BMW Finance NV 13/07/2026                                | 92 853           | 0,13              | 100 000 0.625% Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 02/11/2040  | 63 353           | 0,09              |
| 100 000 1.125% BMW Finance NV 10/01/2028                                | 91 178           | 0,12              | 150 000 0.500% Citigroup Inc 08/10/2027                                 | 131 856          | 0,18              |
| 100 000 1.500% BMW Finance NV 06/02/2029                                | 90 892           | 0,12              | 150 000 1.500% Citigroup Inc 26/10/2028                                 | 130 713          | 0,18              |
| 100 000 4.032% BNP Paribas Cardiff SA (Perpetual)                       | 95 575           | 0,13              | 100 000 4.112% Citigroup Inc 22/09/2033                                 | 97 468           | 0,13              |
| 130 000 1.000% BNP Paribas SA 17/04/2024                                | 126 415          | 0,17              | 200 000 2.500% Citycon Treasury BV 01/10/2024                           | 190 680          | 0,26              |
| 100 000 1.000% BNP Paribas SA 27/06/2024                                | 96 666           | 0,13              | 200 000 1.250% Citycon Treasury BV 08/09/2026                           | 156 178          | 0,21              |
| 100 000 1.125% BNP Paribas SA 28/08/2024                                | 96 543           | 0,13              | 185 000 1.625% Citycon Treasury BV 12/03/2028                           | 132 073          | 0,18              |
| 100 000 2.375% BNP Paribas SA 17/02/2025                                | 96 855           | 0,13              | 300 000 1.750% CNH Industrial Finance Europe SA 12/09/2025              | 289 677          | 0,40              |
| 200 000 1.625% BNP Paribas SA 23/02/2026                                | 190 414          | 0,26              | 100 000 1.625% CNH Industrial Finance Europe SA 03/07/2029              | 88 590           | 0,12              |
| 100 000 0.125% BNP Paribas SA 04/09/2026                                | 89 078           | 0,12              | 300 000 0.375% CNP Assurances 08/03/2028                                | 244 455          | 0,33              |
| 150 000 2.875% BNP Paribas SA 01/10/2026                                | 143 880          | 0,20              | 200 000 2.750% CNP Assurances 05/02/2029                                | 181 164          | 0,25              |
| 200 000 2.125% BNP Paribas SA 23/01/2027                                | 188 496          | 0,26              | 300 000 4.250% CNP Assurances 05/06/2045                                | 290 466          | 0,40              |
| 200 000 0.250% BNP Paribas SA 13/04/2027                                | 176 740          | 0,24              | 400 000 4.500% CNP Assurances 10/06/2047                                | 391 020          | 0,53              |
| 190 000 1.500% BNP Paribas SA 23/05/2028                                | 165 891          | 0,23              | 100 000 2.000% CNP Assurances 27/07/2050                                | 81 114           | 0,11              |
| 500 000 1.500% BNP Paribas SA 25/05/2028                                | 447 390          | 0,61              | 100 000 2.500% CNP Assurances 30/06/2051                                | 80 844           | 0,11              |
| 100 000 0.500% BNP Paribas SA 01/09/2028                                | 84 711           | 0,12              | 100 000 1.875% CNP Assurances 12/10/2053                                | 71 360           | 0,10              |
| 100 000 0.500% BNP Paribas SA 19/01/2030                                | 80 253           | 0,11              | 200 000 4.000% CNP Assurances (Perpetual)                               | 194 436          | 0,27              |
| 100 000 0.875% BNP Paribas SA 11/07/2030                                | 81 069           | 0,11              | 130 000 1.500% Coca-Cola Europacific Partners PLC 08/11/2027            | 117 942          | 0,16              |
| 100 000 2.500% BNP Paribas SA 31/03/2032                                | 90 468           | 0,12              | 100 000 0.625% Coca-Cola HBC Finance BV 21/11/2029                      | 82 193           | 0,11              |
| 100 000 2.100% BNP Paribas SA 07/04/2032                                | 84 491           | 0,12              | 300 000 0.875% Cofinimmo SA 02/12/2030                                  | 207 999          | 0,28              |
| 100 000 1.125% CaixaBank SA 17/05/2024                                  | 96 982           | 0,13              | 100 000 0.750% Comcast Corp 20/02/2032                                  | 78 258           | 0,11              |
| 100 000 1.000% CaixaBank SA 25/06/2024                                  | 96 289           | 0,13              |   |                  |                   |
| 100 000 0.625% CaixaBank SA 01/10/2024                                  | 95 321           | 0,13              |   |                  |                   |
| 100 000 1.125% CaixaBank SA 27/03/2026                                  | 92 787           | 0,13              |   |                  |                   |
| 100 000 0.750% CaixaBank SA 10/07/2026                                  | 93 240           | 0,13              |   |                  |                   |
| 100 000 0.625% CaixaBank SA 21/01/2028                                  | 88 743           | 0,12              |   |                  |                   |
| 100 000 2.250% CaixaBank SA 17/04/2030                                  | 92 862           | 0,13              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 98,91 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 220 000 1.625% Covivio 17/10/2024                                       | 212 608          | 0,29              |
| 200 000 1.875% Covivio 20/05/2026                                       | 187 124          | 0,26              |
| 300 000 1.500% Covivio 21/06/2027                                       | 264 495          | 0,36              |
| 100 000 2.375% Covivio 20/02/2028                                       | 89 571           | 0,12              |
| 200 000 1.625% Covivio 23/06/2030                                       | 165 504          | 0,23              |
| 200 000 1.125% Covivio 17/09/2031                                       | 149 734          | 0,20              |
| 100 000 1.500% Credit Agricole Assurances SA 06/10/2031                 | 76 111           | 0,10              |
| 100 000 0.875% Credit Agricole SA 14/01/2032                            | 76 995           | 0,11              |
| 100 000 1.125% Credit Agricole SA 12/07/2032                            | 77 934           | 0,11              |
| 100 000 1.000% Credit Agricole SA/London 03/07/2029                     | 85 762           | 0,12              |
| 100 000 1.250% CRH SMW Finance DAC 05/11/2026                           | 92 446           | 0,13              |
| 110 000 2.100% Danaher Corp 30/09/2026                                  | 105 725          | 0,14              |
| 300 000 1.250% Danone SA 30/05/2024                                     | 293 745          | 0,40              |
| 500 000 0.709% Danone SA 03/11/2024                                     | 482 100          | 0,66              |
| 300 000 1.125% Danone SA 14/01/2025                                     | 289 083          | 0,40              |
| 100 000 1.000% Danone SA 26/03/2025                                     | 96 084           | 0,13              |
| 100 000 0.000% Danone SA 01/12/2025                                     | 91 868           | 0,13              |
| 200 000 1.208% Danone SA 03/11/2028                                     | 178 192          | 0,24              |
| 100 000 0.520% Danone SA 09/11/2030                                     | 81 193           | 0,11              |
| 200 000 1.000% Danone SA (Perpetual)                                    | 171 834          | 0,24              |
| 100 000 0.500% Danske Bank A/S 27/08/2025                               | 94 729           | 0,13              |
| 100 000 4.000% Danske Bank A/S 12/01/2027                               | 99 874           | 0,14              |
| 100 000 1.000% Deutsche Bank AG 19/11/2025                              | 92 403           | 0,13              |
| 100 000 1.625% Deutsche Bank AG 20/01/2027                              | 86 133           | 0,12              |
| 100 000 0.750% Deutsche Bank AG 17/02/2027                              | 86 836           | 0,12              |
| 100 000 4.000% Deutsche Bank AG 29/11/2027                              | 98 208           | 0,13              |
| 200 000 1.750% Deutsche Bank AG 19/11/2030                              | 156 984          | 0,21              |
| 100 000 1.375% Deutsche Bank AG 17/02/2032                              | 73 752           | 0,10              |
| 100 000 0.375% Deutsche Post AG 20/05/2026                              | 92 610           | 0,13              |
| 120 000 1.000% Deutsche Post AG 20/05/2032                              | 97 962           | 0,13              |
| 100 000 0.875% Deutsche Telekom AG 25/03/2026                           | 93 750           | 0,13              |
| 50 000 0.500% Deutsche Telekom AG 05/07/2027                            | 44 822           | 0,06              |
| 280 000 1.750% Deutsche Telekom AG 09/12/2049                           | 183 344          | 0,25              |
| 100 000 1.375% Deutsche Telekom International Finance BV 01/12/2025     | 96 057           | 0,13              |
| 100 000 1.375% Deutsche Telekom International Finance BV 30/01/2027     | 93 133           | 0,13              |
| 100 000 4.500% Deutsche Telekom International Finance BV 28/10/2030     | 104 952          | 0,14              |
| 100 000 7.500% Deutsche Telekom International Finance BV 24/01/2033     | 128 788          | 0,18              |
| 100 000 0.450% DH Europe Finance II Sarl 18/03/2028                     | 86 513           | 0,12              |

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 98,91 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 1.350% DH Europe Finance II Sarl 18/09/2039                     | 68 865           | 0,09              |
| 100 000 0.125% Diageo Capital BV 28/09/2028                             | 84 255           | 0,12              |
| 160 000 0.500% Diageo Finance PLC 19/06/2024                            | 154 627          | 0,21              |
| 130 000 1.750% Diageo Finance PLC 23/09/2024                            | 127 219          | 0,17              |
| 340 000 1.000% Diageo Finance PLC 22/04/2025                            | 324 329          | 0,44              |
| 550 000 2.375% Diageo Finance PLC 20/05/2026                            | 533 967          | 0,73              |
| 200 000 1.500% Diageo Finance PLC 22/10/2027                            | 185 096          | 0,25              |
| 130 000 2.500% Diageo Finance PLC 27/03/2032                            | 120 201          | 0,16              |
| 100 000 0.950% DXC Capital Funding DAC 15/09/2031                       | 71 578           | 0,10              |
| 100 000 1.625% EDP - Energias de Portugal SA 15/04/2027                 | 92 505           | 0,13              |
| 100 000 1.625% EDP Finance BV 26/01/2026                                | 95 571           | 0,13              |
| 100 000 0.375% EDP Finance BV 16/09/2026                                | 89 547           | 0,12              |
| 200 000 1.250% Enagas Financiaciones SA 06/02/2025                      | 191 626          | 0,26              |
| 200 000 0.750% Enagas Financiaciones SA 27/10/2026                      | 182 886          | 0,25              |
| 200 000 1.375% Enagas Financiaciones SA 05/05/2028                      | 183 080          | 0,25              |
| 200 000 0.375% Enagas Financiaciones SA 05/11/2032                      | 152 226          | 0,21              |
| 160 000 0.000% Enel Finance International NV 17/06/2024                 | 153 469          | 0,21              |
| 150 000 1.000% Enel Finance International NV 16/09/2024                 | 144 846          | 0,20              |
| 140 000 0.000% Enel Finance International NV 28/05/2026                 | 125 187          | 0,17              |
| 100 000 1.375% Enel Finance International NV 01/06/2026                 | 94 087           | 0,13              |
| 100 000 0.000% Enel Finance International NV 17/06/2027                 | 85 487           | 0,12              |
| 200 000 0.875% Enel Finance International NV 28/09/2034                 | 139 252          | 0,19              |
| 100 000 3.500% Enel SpA 24/05/2080                                      | 95 120           | 0,13              |
| 100 000 1.375% Enel SpA (Perpetual)                                     | 80 708           | 0,11              |
| 200 000 1.875% Enel SpA (Perpetual)                                     | 143 488          | 0,20              |
| 100 000 1.375% Engie SA 27/03/2025                                      | 96 035           | 0,13              |
| 100 000 1.000% Engie SA 13/03/2026                                      | 93 211           | 0,13              |
| 100 000 1.750% Engie SA 27/03/2028                                      | 92 095           | 0,13              |
| 100 000 0.375% Engie SA 26/10/2029                                      | 81 516           | 0,11              |
| 200 000 1.875% Engie SA 19/09/2033                                      | 166 324          | 0,23              |
| 100 000 1.000% Engie SA 26/10/2036                                      | 68 864           | 0,09              |
| 100 000 1.375% Engie SA 21/06/2039                                      | 67 572           | 0,09              |
| 100 000 3.875% Engie SA (Perpetual)                                     | 98 732           | 0,14              |
| 100 000 0.625% Eni SpA 19/09/2024                                       | 96 171           | 0,13              |

## SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 98,91 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 3.750% Eni SpA 12/09/2025                                       | 100 579          | 0,14              |
| 100 000 1.500% Eni SpA 02/02/2026                                       | 94 657           | 0,13              |
| 100 000 0.625% Eni SpA 23/01/2030                                       | 81 167           | 0,11              |
| 100 000 2.000% Eni SpA (Perpetual)                                      | 84 290           | 0,12              |
| 100 000 2.750% Eni SpA (Perpetual)                                      | 77 306           | 0,11              |
| 100 000 0.375% Erste Group Bank AG 16/04/2024                           | 96 649           | 0,13              |
| 100 000 0.875% Erste Group Bank AG 13/05/2027                           | 87 776           | 0,12              |
| 100 000 0.500% Essity AB 03/02/2030                                     | 80 580           | 0,11              |
| 130 000 1.560% Experian Europe DAC 16/05/2031                           | 109 906          | 0,15              |
| 300 000 1.500% Gecina SA 20/01/2025                                     | 287 955          | 0,39              |
| 300 000 1.375% Gecina SA 30/06/2027                                     | 274 182          | 0,38              |
| 300 000 1.375% Gecina SA 26/01/2028                                     | 269 319          | 0,37              |
| 200 000 1.000% Gecina SA 30/01/2029                                     | 168 672          | 0,23              |
| 300 000 1.625% Gecina SA 14/03/2030                                     | 253 635          | 0,35              |
| 100 000 2.000% Gecina SA 30/06/2032                                     | 83 316           | 0,11              |
| 100 000 0.875% Gecina SA 30/06/2036                                     | 65 071           | 0,09              |
| 40 000 0.450% General Mills Inc 15/01/2026                              | 36 721           | 0,05              |
| 100 000 2.200% General Motors Financial Co Inc 01/04/2024               | 98 501           | 0,13              |
| 200 000 1.375% GlaxoSmithKline Capital PLC 02/12/2024                   | 194 350          | 0,27              |
| 250 000 4.000% GlaxoSmithKline Capital PLC 16/06/2025                   | 253 992          | 0,35              |
| 100 000 1.000% GlaxoSmithKline Capital PLC 12/09/2026                   | 92 993           | 0,13              |
| 100 000 1.750% GlaxoSmithKline Capital PLC 21/05/2030                   | 89 459           | 0,12              |
| 150 000 0.125% Goldman Sachs Group Inc 19/08/2024                       | 143 010          | 0,20              |
| 175 000 3.375% Goldman Sachs Group Inc 27/03/2025                       | 173 824          | 0,24              |
| 75 000 2.000% Goldman Sachs Group Inc 01/11/2028                        | 67 719           | 0,09              |
| 100 000 0.875% Goldman Sachs Group Inc 09/05/2029                       | 82 301           | 0,11              |
| 140 000 4.000% Goldman Sachs Group Inc 21/09/2029                       | 138 179          | 0,19              |
| 100 000 3.000% Goldman Sachs Group Inc 12/02/2031                       | 92 333           | 0,13              |
| 245 000 1.750% Hammerson Ireland Finance DAC 03/06/2027                 | 196 823          | 0,27              |
| 100 000 1.625% HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 07/04/2026        | 93 573           | 0,13              |
| 50 000 1.125% HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 01/12/2027         | 44 513           | 0,06              |
| 100 000 1.500% Heineken NV 07/12/2024                                   | 96 568           | 0,13              |
| 130 000 1.375% Heineken NV 29/01/2027                                   | 119 762          | 0,16              |
| 140 000 1.750% Heineken NV 17/03/2031                                   | 121 934          | 0,17              |

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 98,91 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 430 000 1.750% Heineken NV 07/05/2040                                   | 311 204          | 0,43              |
| 200 000 0.500% Henkel AG & Co KGaA 17/11/2032                           | 152 198          | 0,21              |
| 100 000 2.250% Holcim Finance Luxembourg SA 26/05/2028                  | 91 846           | 0,13              |
| 100 000 0.625% Holcim Finance Luxembourg SA 06/04/2030                  | 79 250           | 0,11              |
| 200 000 0.625% Holcim Finance Luxembourg SA 19/01/2033                  | 140 410          | 0,19              |
| 100 000 0.875% Iberdrola Finanzas SA 16/06/2025                         | 94 829           | 0,13              |
| 100 000 1.250% Iberdrola Finanzas SA 28/10/2026                         | 93 686           | 0,13              |
| 100 000 1.575% Iberdrola Finanzas SA (Perpetual)                        | 82 846           | 0,11              |
| 100 000 1.825% Iberdrola International BV (Perpetual)                   | 76 663           | 0,10              |
| 100 000 1.874% Iberdrola International BV (Perpetual)                   | 89 916           | 0,12              |
| 200 000 2.250% Iberdrola International BV (Perpetual)                   | 163 082          | 0,22              |
| 200 000 1.125% ICADE 17/11/2025   | 186 582          | 0,26              |
| 300 000 1.750% ICADE 10/06/2026   | 279 537          | 0,38              |
| 300 000 1.500% ICADE 13/09/2027   | 267 231          | 0,37              |
| 300 000 1.625% ICADE 28/02/2028   | 262 347          | 0,36              |
| 200 000 0.625% ICADE 18/01/2031   | 145 346          | 0,20              |
| 200 000 0.875% Icade Sante SACA 04/11/2029                              | 158 108          | 0,22              |
| 300 000 1.375% Icade Sante SACA 17/09/2030                              | 229 866          | 0,31              |
| 100 000 2.000% Infineon Technologies AG 24/06/2032                      | 85 777           | 0,12              |
| 100 000 2.125% Informa PLC 06/10/2025                                   | 95 321           | 0,13              |
| 100 000 0.750% Inmobiliaria Colonial Socimi SA 22/06/2029               | 80 528           | 0,11              |
| 50 000 1.500% International Business Machines Corp 23/05/2029           | 44 430           | 0,06              |
| 150 000 1.750% International Business Machines Corp 31/01/2031          | 130 521          | 0,18              |
| 180 000 1.000% Intesa Sanpaolo SpA 04/07/2024                           | 173 770          | 0,24              |
| 100 000 0.750% Intesa Sanpaolo SpA 04/12/2024                           | 95 061           | 0,13              |
| 100 000 2.125% Intesa Sanpaolo SpA 26/05/2025                           | 96 290           | 0,13              |
| 150 000 4.750% Intesa Sanpaolo SpA 06/09/2027                           | 150 036          | 0,21              |
| 100 000 0.750% Intesa Sanpaolo SpA 16/03/2028                           | 85 130           | 0,12              |
| 100 000 1.750% Intesa Sanpaolo SpA 20/03/2028                           | 89 453           | 0,12              |
| 350 000 1.750% Intesa Sanpaolo SpA 04/07/2029                           | 300 111          | 0,41              |
| 330 000 5.250% Intesa Sanpaolo SpA 13/01/2030                           | 342 728          | 0,47              |
| 320 000 1.350% Intesa Sanpaolo SpA 24/02/2031                           | 240 118          | 0,33              |
| 100 000 1.000% Iren SpA 01/07/2030                                      | 80 939           | 0,11              |
| 100 000 0.650% Johnson & Johnson 20/05/2024                             | 97 422           | 0,13              |
| 100 000 1.650% Johnson & Johnson 20/05/2035                             | 84 201           | 0,12              |

## SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b>                   |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b>             |                  |                   |
| <b>Euro – 98,91 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Euro – 98,91 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 3.000% Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA 15/09/2028 | 95 907           | 0,13              | 50 000 1.375% Medtronic Global Holdings SCA 15/10/2040                              | 34 310           | 0,05              |
| 190 000 1.090% JPMorgan Chase & Co 11/03/2027   | 174 764          | 0,24              | 410 000 1.750% Medtronic Global Holdings SCA 02/07/2049                             | 258 325          | 0,35              |
| 150 000 0.389% JPMorgan Chase & Co 24/02/2028   | 130 000          | 0,18              | 100 000 2.375% Mercedes-Benz Group AG 22/05/2030                                    | 93 796           | 0,13              |
| 230 000 1.638% JPMorgan Chase & Co 18/05/2028   | 208 102          | 0,28              | 100 000 1.125% Mercedes-Benz Group AG 06/11/2031                                    | 81 630           | 0,11              |
| 100 000 1.963% JPMorgan Chase & Co 23/03/2030   | 88 440           | 0,12              | 75 000 1.125% Mercedes-Benz Group AG 08/08/2034                                     | 57 854           | 0,08              |
| 100 000 0.597% JPMorgan Chase & Co 17/02/2033   | 74 571           | 0,10              | 150 000 2.625% Mercedes-Benz International Finance BV 07/04/2025                    | 148 462          | 0,20              |
| 100 000 0.250% KBC Group NV 01/03/2027  | 89 721           | 0,12              | 190 000 1.500% Mercedes-Benz International Finance BV 09/02/2027                    | 178 319          | 0,24              |
| 100 000 0.500% KBC Group NV 03/12/2029  | 92 496           | 0,13              | 140 000 0.625% Mercedes-Benz International Finance BV 06/05/2027                    | 125 790          | 0,17              |
| 100 000 3.000% KBC Group NV 25/08/2030  | 93 057           | 0,13              | 100 000 1.800% Mercialis SA 27/02/2026  | 89 336           | 0,12              |
| 100 000 0.625% KBC Group NV 07/12/2031  | 85 989           | 0,12              | 100 000 0.500% Merck & Co Inc 02/11/2024  | 95 730           | 0,13              |
| 100 000 1.000% Kellogg Co 17/05/2024  | 97 075           | 0,13              | 100 000 0.875% Merck Financial Services GmbH 05/07/2031                             | 82 543           | 0,11              |
| 100 000 1.250% Kering SA 05/05/2025   | 95 756           | 0,13              | 310 000 3.375% Merck KGaA 12/12/2074  | 303 474          | 0,42              |
| 100 000 1.500% Kering SA 05/04/2027   | 93 441           | 0,13              | 200 000 2.875% Merck KGaA 25/06/2079  | 175 020          | 0,24              |
| 100 000 0.750% Kering SA 13/05/2028   | 88 339           | 0,12              | 200 000 1.625% Merck KGaA 09/09/2080  | 176 892          | 0,24              |
| 400 000 1.875% Klepierre SA 19/02/2026  | 378 664          | 0,52              | 100 000 3.125% Microsoft Corp 06/12/2028  | 100 141          | 0,14              |
| 300 000 1.375% Klepierre SA 16/02/2027  | 272 838          | 0,37              | 100 000 0.000% Mondelez International Holdings Netherlands BV 22/09/2026            | 88 094           | 0,12              |
| 200 000 2.000% Klepierre SA 12/05/2029  | 172 652          | 0,24              | 200 000 0.750% Mondelez International Inc 17/03/2033                                | 147 536          | 0,20              |
| 100 000 0.625% Klepierre SA 01/07/2030  | 75 797           | 0,10              | 130 000 1.500% Mondi Finance PLC 15/04/2024   | 126 881          | 0,17              |
| 100 000 0.875% Klepierre SA 17/02/2031  | 74 480           | 0,10              | 200 000 1.625% Mondi Finance PLC 27/04/2026   | 185 842          | 0,25              |
| 200 000 1.625% Klepierre SA 13/12/2032  | 152 176          | 0,21              | 100 000 0.950% Moody's Corp 25/02/2030  | 83 662           | 0,11              |
| 100 000 0.750% Koninklijke DSM NV 28/09/2026  | 91 924           | 0,13              | 100 000 1.375% Morgan Stanley 27/10/2026  | 92 810           | 0,13              |
| 100 000 5.625% Koninklijke KPN NV 30/09/2024  | 103 059          | 0,14              | 100 000 1.875% Morgan Stanley 27/04/2027  | 92 921           | 0,13              |
| 100 000 2.000% Koninklijke Philips NV 30/03/2030  | 88 552           | 0,12              | 140 000 0.406% Morgan Stanley 29/10/2027  | 122 312          | 0,17              |
| 100 000 1.625% Linde Inc/CT 01/12/2025  | 95 823           | 0,13              | 170 000 4.813% Morgan Stanley 25/10/2028  | 173 941          | 0,24              |
| 100 000 0.000% Linde PLC 30/09/2026   | 89 778           | 0,12              | 200 000 1.102% Morgan Stanley 29/04/2033  | 152 340          | 0,21              |
| 100 000 1.625% Linde PLC 31/03/2035   | 81 824           | 0,11              | 100 000 3.250% Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen 26/05/2049 | 90 434           | 0,12              |
| 100 000 0.375% Lloyds Bank Corporate Markets PLC 28/01/2025                                     | 94 067           | 0,13              | 100 000 1.250% National Australia Bank Ltd 18/05/2026                               | 93 990           | 0,13              |
| 140 000 0.500% Lloyds Banking Group PLC 12/11/2025  | 132 616          | 0,18              | 100 000 2.125% National Australia Bank Ltd 24/05/2028                               | 93 611           | 0,13              |
| 100 000 3.500% Lloyds Banking Group PLC 01/04/2026  | 98 849           | 0,14              | 100 000 1.375% Naturgy Finance BV 21/01/2025  | 95 836           | 0,13              |
| 700 000 0.875% L'Oreal SA 29/06/2026  | 652 540          | 0,89              | 200 000 1.250% Naturgy Finance BV 15/01/2026  | 187 030          | 0,26              |
| 100 000 4.125% Mapfre SA 07/09/2048   | 91 357           | 0,12              | 200 000 0.750% Naturgy Finance BV 28/11/2029  | 166 180          | 0,23              |
| 100 000 1.125% Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 15/07/2025                           | 94 087           | 0,13              | 50 000 1.125% Nestle Finance International Ltd 01/04/2026                           | 47 438           | 0,06              |
| 100 000 4.625% Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 07/02/2029                           | 99 899           | 0,14              |   |                  |                   |
| 200 000 1.125% Medtronic Global Holdings SCA 07/03/2027   | 183 750          | 0,25              |   |                  |                   |
| 180 000 3.000% Medtronic Global Holdings SCA 15/10/2028   | 175 934          | 0,24              |   |                  |                   |
| 100 000 2.250% Medtronic Global Holdings SCA 07/03/2039   | 80 461           | 0,11              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets | Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b>       |                     |                         | <b>Valeurs mobilières – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b>       |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b> |                     |                         | <b>Obligations d'entreprise – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 98,91 % (suite)</b>   |                     |                         | <b>Euro – 98,91 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 100 000 0.000% Nestle Finance International Ltd<br>14/06/2026           | 90 732              | 0,12                    | 100 000 0.500% Santander Consumer Bank AS<br>11/08/2025                 | 91 998              | 0,13                    |
| 150 000 0.625% Nestle Finance International Ltd<br>14/02/2034           | 113 487             | 0,16                    | 100 000 0.000% Santander Consumer Finance SA<br>23/02/2026              | 89 112              | 0,12                    |
| 300 000 1.750% Nestle Finance International Ltd<br>02/11/2037           | 245 511             | 0,34                    | 100 000 0.750% SAP SE 10/12/2024  | 95 933              | 0,13                    |
| 100 000 0.375% Nestle Finance International Ltd<br>03/12/2040           | 59 625              | 0,08                    | 250 000 1.000% SAP SE 01/04/2025  | 241 405             | 0,33                    |
| 100 000 4.625% NN Group NV 13/01/2048                                   | 95 202              | 0,13                    | 200 000 1.000% SAP SE 13/03/2026  | 188 290             | 0,26                    |
| 120 000 4.375% NN Group NV (Perpetual)                                  | 117 636             | 0,16                    | 540 000 1.750% SAP SE 22/02/2027  | 516 213             | 0,71                    |
| 100 000 0.000% Novartis Finance SA 23/09/2028                           | 84 009              | 0,11                    | 200 000 1.375% SAP SE 13/03/2030  | 177 092             | 0,24                    |
| 100 000 1.375% Novo Nordisk Finance Netherlands<br>BV 31/03/2030        | 88 473              | 0,12                    | 300 000 1.625% SAP SE 10/03/2031  | 264 336             | 0,36                    |
| 100 000 1.500% OMV AG 09/04/2024  | 97 997              | 0,13                    | 400 000 0.250% Schneider Electric SE 09/09/2024                         | 384 388             | 0,53                    |
| 100 000 3.500% OMV AG 27/09/2027  | 99 853              | 0,14                    | 200 000 0.875% Schneider Electric SE 11/03/2025                         | 191 580             | 0,26                    |
| 100 000 2.500% OMV AG (Perpetual)                                       | 88 698              | 0,12                    | 100 000 0.875% Schneider Electric SE 13/12/2026                         | 91 866              | 0,13                    |
| 160 000 0.875% PepsiCo Inc 18/07/2028                                   | 140 998             | 0,19                    | 100 000 1.375% Schneider Electric SE 21/06/2027                         | 92 546              | 0,13                    |
| 100 000 0.400% PepsiCo Inc 09/10/2032                                   | 75 875              | 0,10                    | 100 000 3.250% Schneider Electric SE 09/11/2027                         | 100 005             | 0,14                    |
| 400 000 2.125% Pernod Ricard SA 27/09/2024                              | 392 568             | 0,54                    | 100 000 1.500% Schneider Electric SE 15/01/2028                         | 92 573              | 0,13                    |
| 300 000 1.500% Pernod Ricard SA 18/05/2026                              | 282 528             | 0,39                    | 400 000 0.250% Schneider Electric SE 11/03/2029                         | 337 480             | 0,46                    |
| 100 000 1.750% Pernod Ricard SA 08/04/2030                              | 89 638              | 0,12                    | 100 000 3.500% Schneider Electric SE 09/11/2032                         | 101 161             | 0,14                    |
| 200 000 0.875% Pernod Ricard SA 24/10/2031                              | 161 774             | 0,22                    | 300 000 3.625% SCOR SE 27/05/2048                                       | 271 323             | 0,37                    |
| 50 000 0.500% Procter & Gamble Co 25/10/2024                            | 47 639              | 0,07                    | 100 000 0.250% Siemens<br>Financieringsmaatschappij NV 05/06/2024       | 96 533              | 0,13                    |
| 75 000 4.875% Procter & Gamble Co 11/05/2027                            | 79 845              | 0,11                    | 100 000 0.000% Siemens<br>Financieringsmaatschappij NV 20/02/2026       | 91 315              | 0,12                    |
| 300 000 6.000% PSA Tresorerie GIE 19/09/2033                            | 331 038             | 0,45                    | 50 000 2.875% Siemens<br>Financieringsmaatschappij NV 10/03/2028        | 49 467              | 0,07                    |
| 100 000 0.250% Raiffeisen Bank International AG<br>22/01/2025           | 91 899              | 0,13                    | 100 000 1.000% Siemens<br>Financieringsmaatschappij NV 25/02/2030       | 85 751              | 0,12                    |
| 100 000 1.500% Raiffeisen Bank International AG<br>12/03/2030           | 82 302              | 0,11                    | 100 000 1.375% Siemens<br>Financieringsmaatschappij NV 06/09/2030       | 87 548              | 0,12                    |
| 70 000 2.000% RCI Banque SA 11/07/2024                                  | 68 156              | 0,09                    | 100 000 2.750% Siemens<br>Financieringsmaatschappij NV 09/09/2030       | 95 739              | 0,13                    |
| 100 000 1.625% RCI Banque SA 26/05/2026                                 | 91 908              | 0,13                    | 100 000 3.000% Siemens<br>Financieringsmaatschappij NV 08/09/2033       | 96 479              | 0,13                    |
| 100 000 4.750% RCI Banque SA 06/07/2027                                 | 101 127             | 0,14                    | 50 000 1.750% Siemens<br>Financieringsmaatschappij NV 28/02/2039        | 39 109              | 0,05                    |
| 100 000 0.500% Red Electrica Financiaciones SAU<br>24/05/2033           | 77 549              | 0,11                    | 220 000 2.000% Signify NV 11/05/2024                                    | 215 450             | 0,29                    |
| 100 000 2.250% Repsol International Finance BV<br>10/12/2026            | 96 054              | 0,13                    | 270 000 2.375% Signify NV 11/05/2027                                    | 252 650             | 0,35                    |
| 100 000 2.625% Repsol International Finance BV<br>15/04/2030            | 95 392              | 0,13                    | 100 000 2.500% Sky Ltd 15/09/2026                                       | 96 840              | 0,13                    |
| 100 000 0.250% Royal Bank of Canada 02/05/2024                          | 96 339              | 0,13                    | 100 000 1.500% Smurfit Kappa Treasury ULC<br>15/09/2027                 | 90 087              | 0,12                    |
| 100 000 2.500% Sampo Oyj 03/09/2052                                     | 77 163              | 0,11                    | 100 000 0.125% Societe Generale SA 24/02/2026                           | 90 052              | 0,12                    |
| 100 000 3.000% Sandvik AB 18/06/2026                                    | 98 572              | 0,13                    | 100 000 0.750% Societe Generale SA 25/01/2027                           | 87 778              | 0,12                    |
| 100 000 1.500% Sanofi 22/09/2025  | 95 967              | 0,13                    | 100 000 0.125% Societe Generale SA 18/02/2028                           | 83 891              | 0,11                    |
| 200 000 1.000% Sanofi 21/03/2026  | 187 922             | 0,26                    | 100 000 2.125% Societe Generale SA 27/09/2028                           | 88 935              | 0,12                    |
| 100 000 0.500% Sanofi 13/01/2027  | 90 752              | 0,12                    | 200 000 0.875% Societe Generale SA 24/09/2029                           | 160 368             | 0,22                    |
| 100 000 1.125% Sanofi 05/04/2028  | 90 355              | 0,12                    | 100 000 1.250% Societe Generale SA 12/06/2030                           | 80 403              | 0,11                    |
| 100 000 1.875% Sanofi 21/03/2038  | 82 309              | 0,11                    | 200 000 1.000% Societe Generale SA 24/11/2030                           | 176 060             | 0,24                    |

## SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur EUR | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 98,91 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Euro – 98,91 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 100 000 0.500% Solvay SA 06/09/2029                                     | 83 141           | 0,11              | 200 000 2.125% TotalEnergies SE (Perpetual)                             | 144 622          | 0,20              |
| 200 000 2.875% SSE PLC 01/08/2029                                       | 191 886          | 0,26              | 180 000 0.440% Toyota Finance Australia Ltd 13/01/2028                  | 155 614          | 0,21              |
| 100 000 3.875% Stellantis NV 05/01/2026                                 | 100 267          | 0,14              | 100 000 0.000% Toyota Motor Finance Netherlands BV 25/02/2028           | 83 652           | 0,11              |
| 300 000 0.625% Stellantis NV 30/03/2027                                 | 265 128          | 0,36              | 100 000 0.750% Traton Finance Luxembourg SA 24/03/2029                  | 83 037           | 0,11              |
| 200 000 4.500% Stellantis NV 07/07/2028                                 | 205 304          | 0,28              | 200 000 0.010% UBS AG/London 29/06/2026                                 | 176 548          | 0,24              |
| 550 000 0.750% Stellantis NV 18/01/2029                                 | 460 746          | 0,63              | 200 000 0.250% UBS Group AG 05/11/2028                                  | 164 178          | 0,22              |
| 200 000 1.125% Stellantis NV 18/09/2029                                 | 169 680          | 0,23              | 200 000 0.875% UBS Group AG 03/11/2031                                  | 145 132          | 0,20              |
| 240 000 2.750% Stellantis NV 01/04/2032                                 | 213 463          | 0,29              | 260 000 0.875% Unibail-Rodamco-Westfield SE 21/02/2025                  | 244 520          | 0,33              |
| 530 000 1.250% Stellantis NV 20/06/2033                                 | 397 341          | 0,54              | 240 000 1.000% Unibail-Rodamco-Westfield SE 14/03/2025                  | 226 054          | 0,31              |
| 200 000 1.625% Stockland Trust 27/04/2026                               | 181 452          | 0,25              | 100 000 2.125% Unibail-Rodamco-Westfield SE 09/04/2025                  | 95 856           | 0,13              |
| 100 000 0.750% Takeda Pharmaceutical Co Ltd 09/07/2027                  | 88 898           | 0,12              | 100 000 1.125% Unibail-Rodamco-Westfield SE 15/09/2025                  | 92 409           | 0,13              |
| 100 000 3.000% Takeda Pharmaceutical Co Ltd 21/11/2030                  | 94 771           | 0,13              | 100 000 1.375% Unibail-Rodamco-Westfield SE 09/03/2026                  | 91 565           | 0,13              |
| 100 000 1.528% Telefonica Emisiones SA 17/01/2025                       | 96 935           | 0,13              | 250 000 2.500% Unibail-Rodamco-Westfield SE 04/06/2026                  | 234 977          | 0,32              |
| 100 000 1.460% Telefonica Emisiones SA 13/04/2026                       | 94 203           | 0,13              | 100 000 0.750% Unibail-Rodamco-Westfield SE 25/10/2028                  | 79 547           | 0,11              |
| 100 000 1.788% Telefonica Emisiones SA 12/03/2029                       | 90 272           | 0,12              | 100 000 2.625% Unibail-Rodamco-Westfield SE 09/04/2030                  | 86 453           | 0,12              |
| 100 000 2.932% Telefonica Emisiones SA 17/10/2029                       | 95 674           | 0,13              | 200 000 1.375% Unibail-Rodamco-Westfield SE 15/04/2030                  | 158 464          | 0,22              |
| 100 000 1.957% Telefonica Emisiones SA 01/07/2039                       | 73 715           | 0,10              | 100 000 1.750% Unibail-Rodamco-Westfield SE 27/02/2034                  | 74 146           | 0,10              |
| 300 000 1.875% Teleperformance 02/07/2025                               | 281 349          | 0,38              | 100 000 2.000% Unibail-Rodamco-Westfield SE 28/04/2036                  | 73 404           | 0,10              |
| 300 000 0.250% Teleperformance 26/11/2027                               | 252 642          | 0,35              | 200 000 2.000% Unibail-Rodamco-Westfield SE 29/05/2037                  | 144 040          | 0,20              |
| 200 000 3.750% Teleperformance 24/06/2029                               | 191 774          | 0,26              | 100 000 1.750% Unibail-Rodamco-Westfield SE 01/07/2049                  | 55 935           | 0,08              |
| 100 000 1.625% Telia Co AB 23/02/2035                                   | 77 612           | 0,11              | 200 000 2.875% Unibail-Rodamco-Westfield SE (Perpetual)                 | 153 614          | 0,21              |
| 100 000 4.625% Telia Co AB 21/12/2082                                   | 96 812           | 0,13              | 100 000 1.250% UniCredit SpA 16/06/2026                                 | 93 712           | 0,13              |
| 150 000 2.750% Telia Co AB 30/06/2083                                   | 131 982          | 0,18              | 140 000 2.125% UniCredit SpA 24/10/2026                                 | 132 066          | 0,18              |
| 100 000 0.125% Tema - Rete Elettrica Nazionale 25/07/2025               | 92 688           | 0,13              | 250 000 2.200% UniCredit SpA 22/07/2027                                 | 228 595          | 0,31              |
| 100 000 1.625% Tikehau Capital SCA 31/03/2029                           | 76 612           | 0,10              | 140 000 1.625% UniCredit SpA 18/01/2032                                 | 108 660          | 0,15              |
| 100 000 0.375% Toronto-Dominion Bank 25/04/2024                         | 96 589           | 0,13              | 100 000 1.250% Unilever Finance Netherlands BV 25/03/2025               | 96 303           | 0,13              |
| 100 000 0.500% Toronto-Dominion Bank 18/01/2027                         | 87 546           | 0,12              | 65 000 1.000% Unilever Finance Netherlands BV 14/02/2027                | 59 557           | 0,08              |
| 100 000 3.129% Toronto-Dominion Bank 03/08/2032                         | 92 007           | 0,13              | 110 000 1.125% Unilever Finance Netherlands BV 29/04/2028               | 98 914           | 0,14              |
| 100 000 2.500% TotalEnergies Capital International SA 25/03/2026        | 98 031           | 0,13              | 100 000 1.625% Unilever Finance Netherlands BV 12/02/2033               | 85 692           | 0,12              |
| 100 000 0.952% TotalEnergies Capital International SA 18/05/2031        | 81 877           | 0,11              |   |                  |                   |
| 100 000 1.535% TotalEnergies Capital International SA 31/05/2039        | 72 906           | 0,10              |   |                  |                   |
| 100 000 2.625% TotalEnergies SE (Perpetual)                             | 94 577           | 0,13              |   |                  |                   |
| 100 000 1.625% TotalEnergies SE (Perpetual)                             | 82 683           | 0,11              |   |                  |                   |
| 100 000 2.000% TotalEnergies SE (Perpetual)                             | 86 631           | 0,12              |   |                  |                   |



## SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b>       |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 98,91 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 100 000 2.250% Unilever Finance Netherlands BV<br>16/05/2034            | 89 927              | 0,12                    |
| 290 000 1.500% Unilever PLC 11/06/2039                                  | 219 341             | 0,30                    |
| 100 000 0.125% UPM-Kymmene Oyj 19/11/2028                               | 82 621              | 0,11                    |
| 100 000 0.000% Veolia Environnement SA<br>09/06/2026                    | 89 928              | 0,12                    |
| 100 000 0.000% Veolia Environnement SA<br>14/01/2027                    | 87 491              | 0,12                    |
| 100 000 1.250% Veolia Environnement SA<br>02/04/2027                    | 91 879              | 0,13                    |
| 100 000 1.590% Veolia Environnement SA<br>10/01/2028                    | 92 252              | 0,13                    |
| 100 000 1.250% Veolia Environnement SA<br>19/05/2028                    | 89 482              | 0,12                    |
| 100 000 0.927% Veolia Environnement SA<br>04/01/2029                    | 86 010              | 0,12                    |
| 300 000 1.940% Veolia Environnement SA<br>07/01/2030                    | 270 708             | 0,37                    |
| 300 000 0.664% Veolia Environnement SA<br>15/01/2031                    | 242 319             | 0,33                    |
| 300 000 0.800% Veolia Environnement SA<br>15/01/2032                    | 236 265             | 0,32                    |
| 200 000 1.625% Veolia Environnement SA<br>21/09/2032                    | 167 360             | 0,23                    |
| 100 000 1.250% Veolia Environnement SA<br>14/05/2035                    | 76 543              | 0,10                    |
| 200 000 2.875% Veolia Environnement SA<br>(Perpetual)                   | 195 284             | 0,27                    |
| 160 000 0.875% Verizon Communications Inc<br>02/04/2025                 | 151 885             | 0,21                    |
| 100 000 1.375% Verizon Communications Inc<br>27/10/2026                 | 92 913              | 0,13                    |
| 150 000 1.300% Verizon Communications Inc<br>18/05/2033                 | 117 600             | 0,16                    |
| 150 000 2.875% Verizon Communications Inc<br>15/01/2038                 | 129 366             | 0,18                    |
| 280 000 1.125% Vicinity Centres Trust 07/11/2029                        | 222 440             | 0,30                    |
| 100 000 1.000% Vinci SA 26/09/2025                                      | 95 240              | 0,13                    |
| 200 000 1.625% Vinci SA 18/01/2029                                      | 181 894             | 0,25                    |
| 100 000 0.500% Vinci SA 09/01/2032                                      | 77 911              | 0,11                    |
| 100 000 0.875% Vivendi SE 18/09/2024                                    | 95 759              | 0,13                    |
| 100 000 2.200% Vodafone Group PLC 25/08/2026                            | 96 568              | 0,13                    |
| 120 000 1.500% Vodafone Group PLC 24/07/2027                            | 110 868             | 0,15                    |
| 100 000 1.875% Vodafone Group PLC 20/11/2029                            | 88 971              | 0,12                    |
| 100 000 2.875% Vodafone Group PLC 20/11/2037                            | 86 262              | 0,12                    |
| 100 000 1.250% Volkswagen Bank GmbH<br>10/06/2024                       | 97 042              | 0,13                    |
| 200 000 3.000% Volkswagen Financial Services AG<br>06/04/2025           | 197 990             | 0,27                    |

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b>       |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,91 % (mars 2022 : 98,83 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 98,91 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 100 000 3.875% Volkswagen International Finance<br>NV 29/03/2026        | 99 808              | 0,14                    |
| 200 000 3.750% Volkswagen International Finance<br>NV 28/09/2027        | 197 052             | 0,27                    |
| 100 000 3.250% Volkswagen International Finance<br>NV 18/11/2030        | 93 498              | 0,13                    |
| 100 000 4.125% Volkswagen International Finance<br>NV 16/11/2038        | 94 663              | 0,13                    |
| 100 000 3.375% Volkswagen International Finance<br>NV (Perpetual)       | 96 495              | 0,13                    |
| 200 000 3.500% Volkswagen International Finance<br>NV (Perpetual)       | 188 602             | 0,26                    |
| 200 000 3.875% Volkswagen International Finance<br>NV (Perpetual)       | 175 972             | 0,24                    |
| 100 000 4.625% Volkswagen International Finance<br>NV (Perpetual)       | 91 037              | 0,12                    |
| 145 000 0.500% Volkswagen Leasing GmbH<br>12/01/2029                    | 117 652             | 0,16                    |
| 140 000 2.625% Volvo Treasury AB 20/02/2026                             | 136 825             | 0,19                    |
| 100 000 1.625% Vonovia Finance BV 07/04/2024                            | 97 044              | 0,13                    |
| 100 000 1.250% Vonovia Finance BV 06/12/2024                            | 94 836              | 0,13                    |
| 100 000 1.625% Vonovia Finance BV 07/10/2039                            | 55 209              | 0,08                    |
| 100 000 1.375% Vonovia SE 28/01/2026                                    | 90 554              | 0,12                    |
| 200 000 0.250% Vonovia SE 01/09/2028                                    | 152 434             | 0,21                    |
| 100 000 0.750% Vonovia SE 01/09/2032                                    | 64 385              | 0,09                    |
| 100 000 1.625% Vonovia SE 01/09/2051                                    | 45 889              | 0,06                    |
| <b>Total des obligations d'entreprise</b>                               | <b>72 328 296</b>   | <b>98,91</b>            |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>                                     | <b>72 328 296</b>   | <b>98,91</b>            |

|   | Juste valeur<br>EUR | % du<br>Comp. |
|---|---------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | 72 328 296          | 98,91         |
| <b>Disponibilités bancaires*</b><br>(mars 2022 : 0,94 %)                                | 147 997             | 0,20          |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : 0,23 %)</b>  | 648 758             | 0,89          |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs<br/>d'actions de participation rachetables</b> | <b>73 125 051</b>   | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

## SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                                   | <b>% du total des actifs</b> |
|--|------------------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs            | 96,71                        |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé                        | 0,24                         |
| Autres valeurs mobilières du type mentionné dans le Règlement 68(1)(a), (b) et (c) | 0,11                         |
| Autres actifs  | 2,94                         |
| <b>Total des actifs</b>  | <b>100,00</b>                |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |             |
|---|-------|----------------------|----------------------|-------------|
| <b>Actifs circulants</b>  |       |                      |                      |             |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :            |       |                      |                      |             |
|   | 1(e)  |                      |                      |             |
| Valeurs mobilières  |       | 6 739 642 855        | 6 842 699 872        |             |
| Instruments financiers dérivés  |       | 8 381 976            | 757 103              |             |
|   |       | <b>6 748 024 831</b> | <b>6 843 456 975</b> |             |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie   |       |                      |                      |             |
|   | 1(f)  | 21 450 005           | 38 878 784           |             |
| Créances :  |       |                      |                      |             |
| Intérêts à recevoir   |       | 68 258 391           | 60 865 492           |             |
| À recevoir sur cessions d'investissements   |       | 131 091 830          | 97 846 254           |             |
|   |       | <b>6 968 825 057</b> | <b>7 041 047 505</b> |             |
| <b>Total des actifs circulants</b>  |       |                      |                      |             |
| <b>Passifs circulants</b>   |       |                      |                      |             |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :           |       |                      |                      |             |
|   | 1(e)  |                      |                      |             |
| Instruments financiers dérivés  |       | (745 982)            | (1 732 762)          |             |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :  |       |                      |                      |             |
| Charges à payer   |       | (868 130)            | (890 289)            |             |
| À payer sur achats d'investissements  |       | (130 056 180)        | (132 361 715)        |             |
|   |       | <b>(131 670 292)</b> | <b>(134 984 766)</b> |             |
| <b>Total des passifs circulants</b>   |       |                      |                      |             |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> |       |                      |                      |             |
|   |       | <b>6 837 154 765</b> | <b>6 906 062 739</b> |             |
|   |       | <b>2023</b>          | <b>2022</b>          | <b>2021</b> |
| Valeur liquidative par action   |       |                      |                      |             |
| Catégorie non couverte en USD   | 5     | 26,45 USD            | 28,12 USD            | 29,37 USD   |
| Catégorie couverte en EUR*  | 5     | 25,27 EUR            | 27,75 EUR            | -           |

\* Cette catégorie d'actions a été lancée le 11 juin 2021.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|---|-------|----------------------|----------------------|
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 205 829 105          | 129 644 752          |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 9     | (615 921 829)        | (427 086 115)        |
| Produits divers   |       | 234 054              | -                    |
| <b>Total des charges d'investissement</b>   |       | <b>(409 858 670)</b> | <b>(297 441 363)</b> |
| Charges opérationnelles   | 3     | (9 937 801)          | (8 776 246)          |
| <b>Perte nette pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(419 796 471)</b> | <b>(306 217 609)</b> |
| <b>Charges financières</b>  |       |                      |                      |
| Charges d'intérêts  |       | -                    | (2 118)              |
| <b>Perte pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(419 796 471)</b> | <b>(306 219 727)</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement   | 2     | (30 301)             | (509)                |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(419 826 772)</b> | <b>(306 220 236)</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|---|----------------------|----------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier               | 6 906 062 739        | 5 426 286 814        |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(419 826 772)</b> | <b>(306 220 236)</b> |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                      |                      |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 582 939 237          | 2 131 144 110        |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (232 020 439)        | (345 147 949)        |
| Augmentation des actifs nets résultant d'opérations sur actions   | 350 918 798          | 1 785 996 161        |
| <b>(Diminution)/Augmentation totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>    | <b>(68 907 974)</b>  | <b>1 479 775 925</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>        | <b>6 837 154 765</b> | <b>6 906 062 739</b> |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD            |
|---|-------|----------------------|------------------------|
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(419 826 772)</b> | <b>(306 220 236)</b>   |
| <b>Ajustement pour :</b>  |       |                      |                        |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  |       | 67 505 906           | (1 473 619 468)        |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés   |       | (8 611 653)          | 975 659                |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   |       | <b>(360 932 519)</b> | <b>(1 778 864 045)</b> |
| Variation des montants à recevoir   |       | (7 392 899)          | (14 927 729)           |
| Variation des montants à payer  |       | (22 159)             | 199 097                |
| <b>Sorties de trésorerie sur opérations</b>   |       | <b>(7 415 058)</b>   | <b>(14 728 632)</b>    |
| <b>Sorties de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  |       | <b>(368 347 577)</b> | <b>(1 793 592 677)</b> |
| <b>Activités de financement</b>   |       |                      |                        |
| Produits des souscriptions  | 5     | 582 939 237          | 2 131 144 110          |
| Paiements sur rachats   | 5     | (232 020 439)        | (345 147 949)          |
| <b>Trésorerie nette générée sur activités de financement</b>  |       | <b>350 918 798</b>   | <b>1 785 996 161</b>   |
| <b>Diminution nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>   |       | <b>(17 428 779)</b>  | <b>(7 596 516)</b>     |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  |       | 38 878 784           | 46 475 300             |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   |       | <b>21 450 005</b>    | <b>38 878 784</b>      |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |       |                      |                        |
| Impôts payés  |       | (30 301)             | (509)                  |
| Intérêts reçus  |       | 253 407 591          | 183 731 452            |
| Intérêts payés  |       | -                    | (2 118)                |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                                    | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %)</b>               |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %)</b> |                  |                   | <b>(suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 %</b>                               |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                       |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 1 654 000 2.000% 3M Co 14/02/2025                               | 1 576 477        | 0,02              | 225 000 3.150% AEP Transmission Co LLC 15/09/2049                       | 163 580          | 0,00              |
| 2 300 000 2.650% 3M Co 15/04/2025                               | 2 203 216        | 0,03              | 55 000 3.650% AEP Transmission Co LLC 01/04/2050                        | 43 666           | 0,00              |
| 435 000 3.000% 3M Co 07/08/2025                                 | 418 666          | 0,01              | 955 000 4.500% AEP Transmission Co LLC 15/06/2052                       | 873 319          | 0,01              |
| 2 400 000 2.250% 3M Co 19/09/2026                               | 2 229 240        | 0,03              | 730 000 5.400% AEP Transmission Co LLC 15/03/2053                       | 763 113          | 0,01              |
| 457 000 2.875% 3M Co 15/10/2027                                 | 428 104          | 0,01              | 1 207 000 1.375% AES Corp 15/01/2026                                    | 1 084 815        | 0,02              |
| 1 980 000 3.625% 3M Co 14/09/2028                               | 1 907 473        | 0,03              | 2 284 000 2.450% AES Corp 15/01/2031                                    | 1 862 876        | 0,03              |
| 136 000 3.375% 3M Co 01/03/2029                                 | 128 225          | 0,00              | 1 000 000 3.500% Aetna Inc 15/11/2024                                   | 977 100          | 0,01              |
| 343 000 2.375% 3M Co 26/08/2029                                 | 303 150          | 0,00              | 400 000 6.625% Aetna Inc 15/06/2036                                     | 443 840          | 0,01              |
| 438 000 5.700% 3M Co 15/03/2037                                 | 472 050          | 0,01              | 750 000 6.750% Aetna Inc 15/12/2037                                     | 827 363          | 0,01              |
| 398 000 3.875% 3M Co 15/06/2044                                 | 331 900          | 0,00              | 200 000 4.125% Aetna Inc 15/11/2042                                     | 169 304          | 0,00              |
| 70 000 3.125% 3M Co 19/09/2046                                  | 50 475           | 0,00              | 1 000 000 3.875% Aetna Inc 15/08/2047                                   | 794 770          | 0,01              |
| 314 000 4.000% 3M Co 14/09/2048                                 | 266 925          | 0,00              | 2 839 000 2.750% Agilent Technologies Inc 15/09/2029                    | 2 544 255        | 0,04              |
| 1 371 000 3.250% 3M Co 26/08/2049                               | 1 022 026        | 0,02              | 2 245 000 1.500% Air Products and Chemicals Inc 15/10/2025              | 2 087 266        | 0,03              |
| 781 000 3.700% 3M Co 15/04/2050                                 | 641 178          | 0,01              | 1 540 000 1.850% Air Products and Chemicals Inc 15/05/2027              | 1 392 853        | 0,02              |
| 1 900 000 4.375% ABB Finance USA Inc 08/05/2042                 | 1 746 461        | 0,03              | 3 100 000 2.050% Air Products and Chemicals Inc 15/05/2030              | 2 678 834        | 0,04              |
| 1 898 000 2.950% Abbott Laboratories 15/03/2025                 | 1 854 839        | 0,03              | 2 000 000 4.800% Air Products and Chemicals Inc 03/03/2033              | 2 055 540        | 0,03              |
| 736 000 3.875% Abbott Laboratories 15/09/2025                   | 728 574          | 0,01              | 567 000 2.700% Air Products and Chemicals Inc 15/05/2040                | 433 256          | 0,01              |
| 932 000 3.750% Abbott Laboratories 30/11/2026                   | 924 758          | 0,01              | 20 000 2.800% Air Products and Chemicals Inc 15/05/2050                 | 14 373           | 0,00              |
| 250 000 1.150% Abbott Laboratories 30/01/2028                   | 218 348          | 0,00              | 6 816 000 3.450% Alexandria Real Estate Equities Inc 30/04/2025         | 6 535 113        | 0,10              |
| 3 380 000 1.400% Abbott Laboratories 30/06/2030                 | 2 821 455        | 0,04              | 2 200 000 4.300% Alexandria Real Estate Equities Inc 15/01/2026         | 2 152 788        | 0,03              |
| 3 393 000 4.750% Abbott Laboratories 30/11/2036                 | 3 522 172        | 0,05              | 768 000 3.800% Alexandria Real Estate Equities Inc 15/04/2026           | 738 977          | 0,01              |
| 700 000 6.000% Abbott Laboratories 01/04/2039                   | 795 837          | 0,01              | 410 000 3.950% Alexandria Real Estate Equities Inc 15/01/2027           | 394 814          | 0,01              |
| 130 000 5.300% Abbott Laboratories 27/05/2040                   | 139 641          | 0,00              | 1 461 000 3.950% Alexandria Real Estate Equities Inc 15/01/2028         | 1 382 880        | 0,02              |
| 175 000 4.750% Abbott Laboratories 15/04/2043                   | 177 317          | 0,00              | 2 200 000 4.500% Alexandria Real Estate Equities Inc 30/07/2029         | 2 131 052        | 0,03              |
| 5 922 000 4.900% Abbott Laboratories 30/11/2046                 | 6 088 290        | 0,09              | 313 000 2.750% Alexandria Real Estate Equities Inc 15/12/2029           | 268 970          | 0,00              |
| 7 796 000 1.900% Adobe Inc 01/02/2025                           | 7 460 226        | 0,11              | 2 427 000 4.700% Alexandria Real Estate Equities Inc 01/07/2030         | 2 348 535        | 0,03              |
| 20 906 000 3.250% Adobe Inc 01/02/2025                          | 20 488 716       | 0,30              | 1 537 000 4.900% Alexandria Real Estate Equities Inc 15/12/2030         | 1 499 497        | 0,02              |
| 11 284 000 2.150% Adobe Inc 01/02/2027                          | 10 489 070       | 0,15              | 3 129 000 3.375% Alexandria Real Estate Equities Inc 15/08/2031         | 2 749 108        | 0,04              |
| 18 565 000 2.300% Adobe Inc 01/02/2030                          | 16 471 648       | 0,24              |   |                  |                   |
| 670 000 3.924% Advanced Micro Devices Inc 01/06/2032            | 643 294          | 0,01              |   |                  |                   |
| 910 000 4.393% Advanced Micro Devices Inc 01/06/2052            | 846 391          | 0,01              |   |                  |                   |
| 12 640 000 5.500% Aegon NV 11/04/2048                           | 11 950 614       | 0,17              |   |                  |                   |
| 915 000 3.950% AEP Texas Inc 01/06/2028                         | 880 678          | 0,01              |   |                  |                   |
| 2 000 000 4.700% AEP Texas Inc 15/05/2032                       | 1 952 320        | 0,03              |   |                  |                   |
| 74 000 3.800% AEP Texas Inc 01/10/2047                          | 57 462           | 0,00              |   |                  |                   |
| 100 000 3.450% AEP Texas Inc 15/01/2050                         | 73 614           | 0,00              |   |                  |                   |
| 2 000 000 5.250% AEP Texas Inc 15/05/2052                       | 1 950 740        | 0,03              |   |                  |                   |
| 525 000 3.100% AEP Transmission Co LLC 01/12/2026               | 499 359          | 0,01              |   |                  |                   |
| 149 000 3.750% AEP Transmission Co LLC 01/12/2047               | 122 995          | 0,00              |   |                  |                   |
| 1 755 000 4.250% AEP Transmission Co LLC 15/09/2048             | 1 541 557        | 0,02              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 2 000 000 2.000% Alexandria Real Estate Equities Inc 18/05/2032         | 1 528 100        | 0,02              |
| 6 608 000 1.875% Alexandria Real Estate Equities Inc 01/02/2033         | 4 949 326        | 0,07              |
| 500 000 2.950% Alexandria Real Estate Equities Inc 15/03/2034           | 399 845          | 0,01              |
| 200 000 4.750% Alexandria Real Estate Equities Inc 15/04/2035           | 187 390          | 0,00              |
| 900 000 4.850% Alexandria Real Estate Equities Inc 15/04/2049           | 781 497          | 0,01              |
| 3 703 000 4.000% Alexandria Real Estate Equities Inc 01/02/2050         | 2 788 914        | 0,04              |
| 3 600 000 3.000% Alexandria Real Estate Equities Inc 18/05/2051         | 2 212 992        | 0,03              |
| 480 000 5.150% Alexandria Real Estate Equities Inc 15/04/2053           | 439 349          | 0,01              |
| 500 000 0.450% Alphabet Inc 15/08/2025                                  | 459 160          | 0,01              |
| 3 550 000 1.998% Alphabet Inc 15/08/2026                                | 3 326 492        | 0,05              |
| 400 000 0.800% Alphabet Inc 15/08/2027                                  | 350 848          | 0,01              |
| 700 000 1.100% Alphabet Inc 15/08/2030                                  | 572 299          | 0,01              |
| 1 320 000 1.900% Alphabet Inc 15/08/2040                                | 925 109          | 0,01              |
| 870 000 2.050% Alphabet Inc 15/08/2050                                  | 552 598          | 0,01              |
| 4 800 000 2.250% Alphabet Inc 15/08/2060                                | 2 937 696        | 0,04              |
| 2 110 000 4.000% Amcor Flexibles North America Inc 17/05/2025           | 2 066 724        | 0,03              |
| 2 747 000 2.630% Amcor Flexibles North America Inc 19/06/2030           | 2 302 041        | 0,03              |
| 1 905 000 2.690% Amcor Flexibles North America Inc 25/05/2031           | 1 584 446        | 0,02              |
| 300 000 2.875% America Movil SAB de CV 07/05/2030                       | 264 792          | 0,00              |
| 150 000 4.700% America Movil SAB de CV 21/07/2032                       | 147 998          | 0,00              |
| 1 050 000 6.125% America Movil SAB de CV 30/03/2040                     | 1 135 554        | 0,02              |
| 1 100 000 4.375% America Movil SAB de CV 16/07/2042                     | 990 979          | 0,01              |
| 2 000 000 4.375% America Movil SAB de CV 22/04/2049                     | 1 766 220        | 0,03              |
| 2 002 000 1.000% American Electric Power Co Inc 01/11/2025              | 1 818 957        | 0,03              |
| 900 000 5.750% American Electric Power Co Inc 01/11/2027                | 935 433          | 0,01              |
| 2 000 4.300% American Electric Power Co Inc 01/12/2028                  | 1 953            | 0,00              |
| 475 000 2.300% American Electric Power Co Inc 01/03/2030                | 400 696          | 0,01              |
| 1 000 000 5.950% American Electric Power Co Inc 01/11/2032              | 1 064 990        | 0,02              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 2 545 000 5.625% American Electric Power Co Inc 01/03/2033              | 2 637 663        | 0,04              |
| 583 000 3.250% American Electric Power Co Inc 01/03/2050                | 406 234          | 0,01              |
| 1 500 000 3.875% American Electric Power Co Inc 15/02/2062              | 1 177 695        | 0,02              |
| 3 500 000 3.375% American Express Co 03/05/2024                         | 3 432 065        | 0,05              |
| 2 000 000 2.500% American Express Co 30/07/2024                         | 1 933 960        | 0,03              |
| 2 000 000 3.000% American Express Co 30/10/2024                         | 1 950 560        | 0,03              |
| 2 500 000 3.625% American Express Co 05/12/2024                         | 2 439 300        | 0,04              |
| 2 000 000 3.950% American Express Co 01/08/2025                         | 1 962 180        | 0,03              |
| 1 710 000 4.900% American Express Co 13/02/2026                         | 1 723 509        | 0,03              |
| 50 000 3.125% American Express Co 20/05/2026                            | 47 677           | 0,00              |
| 1 500 000 1.650% American Express Co 04/11/2026                         | 1 345 725        | 0,02              |
| 2 100 000 2.550% American Express Co 04/03/2027                         | 1 943 718        | 0,03              |
| 200 000 3.300% American Express Co 03/05/2027                           | 190 252          | 0,00              |
| 3 200 000 5.850% American Express Co 05/11/2027                         | 3 360 544        | 0,05              |
| 1 000 000 4.050% American Express Co 03/05/2029                         | 975 440          | 0,01              |
| 1 000 000 4.989% American Express Co 26/05/2033                         | 982 890          | 0,01              |
| 2 000 000 4.420% American Express Co 03/08/2033                         | 1 917 520        | 0,03              |
| 500 000 4.050% American Express Co 03/12/2042                           | 461 425          | 0,01              |
| 800 000 3.300% American Express Credit Corp 03/05/2027                  | 763 576          | 0,01              |
| 366 000 2.400% American Honda Finance Corp 27/06/2024                   | 355 269          | 0,01              |
| 1 296 000 0.550% American Honda Finance Corp 12/07/2024                 | 1 228 751        | 0,02              |
| 1 000 000 0.750% American Honda Finance Corp 09/08/2024                 | 947 820          | 0,01              |
| 983 000 2.150% American Honda Finance Corp 10/09/2024                   | 947 740          | 0,01              |
| 1 780 000 1.200% American Honda Finance Corp 08/07/2025                 | 1 650 380        | 0,02              |
| 500 000 1.000% American Honda Finance Corp 10/09/2025                   | 458 950          | 0,01              |



## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets  | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|--|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |  | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |  | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |  | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 1 000 000   | 4.750%           | American Honda Finance Corp 12/01/2026                                 | 1 007 950   | 0,01             |                   |
| 575 000   | 2.300%           | American Honda Finance Corp 09/09/2026                                 | 534 888   | 0,01             |                   |
| 99 000  | 2.350%           | American Honda Finance Corp 08/01/2027                                 | 91 885  | 0,00             |                   |
| 1 000 000   | 4.700%           | American Honda Finance Corp 12/01/2028                                 | 1 009 710   | 0,01             |                   |
| 48 000  | 3.500%           | American Honda Finance Corp 15/02/2028                                 | 46 021  | 0,00             |                   |
| 905 000   | 2.000%           | American Honda Finance Corp 24/03/2028                                 | 804 934   | 0,01             |                   |
| 1 000 000   | 2.250%           | American Honda Finance Corp 12/01/2029                                 | 883 450   | 0,01             |                   |
| 750 000   | 1.800%           | American Honda Finance Corp 13/01/2031                                 | 618 248   | 0,01             |                   |
| 514 000   | 3.700%           | Ameriprise Financial Inc 15/10/2024                                    | 503 103   | 0,01             |                   |
| 370 000   | 3.000%           | Ameriprise Financial Inc 02/04/2025                                    | 356 451   | 0,01             |                   |
| 1 100 000   | 2.875%           | Ameriprise Financial Inc 15/09/2026                                    | 1 031 470   | 0,02             |                   |
| 1 430 000   | 4.500%           | Ameriprise Financial Inc 13/05/2032                                    | 1 373 758   | 0,02             |                   |
| 2 330 000   | 5.150%           | Ameriprise Financial Inc 15/05/2033                                    | 2 329 534   | 0,03             |                   |
| 200 000   | 3.400%           | AmerisourceBergen Corp 15/05/2024                                      | 196 208   | 0,00             |                   |
| 1 550 000   | 4.300%           | AmerisourceBergen Corp 15/12/2047                                      | 1 343 401   | 0,02             |                   |
| 1 686 000   | 3.625%           | Amgen Inc 22/05/2024   | 1 662 345   | 0,02             |                   |
| 1 037 000   | 1.900%           | Amgen Inc 21/02/2025   | 985 679   | 0,01             |                   |
| 880 000   | 5.250%           | Amgen Inc 02/03/2025   | 889 812   | 0,01             |                   |
| 1 852 000   | 3.125%           | Amgen Inc 01/05/2025   | 1 797 755   | 0,03             |                   |
| 210 000   | 5.507%           | Amgen Inc 02/03/2026   | 211 002   | 0,00             |                   |
| 1 398 000   | 2.600%           | Amgen Inc 19/08/2026   | 1 316 049   | 0,02             |                   |
| 3 031 000   | 2.200%           | Amgen Inc 21/02/2027   | 2 792 885   | 0,04             |                   |
| 128 000   | 3.200%           | Amgen Inc 02/11/2027   | 121 268   | 0,00             |                   |
| 2 800 000   | 5.150%           | Amgen Inc 02/03/2028   | 2 859 416   | 0,04             |                   |
| 1 000 000   | 4.050%           | Amgen Inc 18/08/2029   | 966 160   | 0,01             |                   |
| 1 520 000   | 2.450%           | Amgen Inc 21/02/2030   | 1 324 513   | 0,02             |                   |
| 1 700 000   | 5.250%           | Amgen Inc 02/03/2030   | 1 736 924   | 0,03             |                   |
| 254 000   | 2.300%           | Amgen Inc 25/02/2031   | 213 754   | 0,00             |                   |
| 2 000 000   | 2.000%           | Amgen Inc 15/01/2032   | 1 629 200   | 0,02             |                   |
| 1 600 000   | 4.200%           | Amgen Inc 01/03/2033   | 1 534 058   | 0,02             |                   |
| 3 725 000   | 5.250%           | Amgen Inc 02/03/2033   | 3 825 687   | 0,06             |                   |
| 200 000   | 6.375%           | Amgen Inc 01/06/2037   | 222 222   | 0,00             |                   |
| 250 000   | 6.400%           | Amgen Inc 01/02/2039   | 273 853   | 0,00             |                   |
| 4 226 000   | 3.150%           | Amgen Inc 21/02/2040   | 3 314 536   | 0,05             |                   |
| 7 000   | 5.750%           | Amgen Inc 15/03/2040   | 7 216   | 0,00             |                   |
| 5 100 000   | 2.800%           | Amgen Inc 15/08/2041   | 3 732 384   | 0,05             |                   |
| 210 000   | 4.950%           | Amgen Inc 01/10/2041   | 200 237   | 0,00             |                   |
| 471 000   | 5.150%           | Amgen Inc 15/11/2041   | 458 410   | 0,01             |                   |
| 50 000  | 5.650%           | Amgen Inc 15/06/2042   | 51 770  | 0,00             |                   |
| 2 315 000   | 5.600%           | Amgen Inc 02/03/2043   | 2 387 043   | 0,04             |                   |
| 3 427 000   | 4.400%           | Amgen Inc 01/05/2045   | 3 020 524   | 0,04             |                   |
| 4 417 000   | 4.563%           | Amgen Inc 15/06/2048   | 4 002 818   | 0,06             |                   |
| 2 590 000   | 3.375%           | Amgen Inc 21/02/2050   | 1 939 470   | 0,03             |                   |
| 3 988 000   | 4.663%           | Amgen Inc 15/06/2051   | 3 628 522   | 0,05             |                   |
| 2 000 000   | 3.000%           | Amgen Inc 15/01/2052   | 1 373 020   | 0,02             |                   |
| 1 055 000   | 4.875%           | Amgen Inc 01/03/2053   | 988 398   | 0,01             |                   |
| 4 255 000   | 5.650%           | Amgen Inc 02/03/2053   | 4 428 349   | 0,06             |                   |
| 2 981 000   | 2.770%           | Amgen Inc 01/09/2053   | 1 905 813   | 0,03             |                   |
| 1 650 000   | 4.400%           | Amgen Inc 22/02/2062   | 1 392 814   | 0,02             |                   |
| 1 765 000   | 5.750%           | Amgen Inc 02/03/2063   | 1 831 135   | 0,03             |                   |
| 1 377 000   | 3.750%           | AngloGold Ashanti Holdings PLC 01/10/2030                              | 1 198 169   | 0,02             |                   |
| 5 380 000   | 3.650%           | Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 01/02/2026 | 5 279 771   | 0,08             |                   |
| 7 619 000   | 4.700%           | Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 01/02/2036 | 7 567 572   | 0,11             |                   |
| 13 925 000  | 4.900%           | Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 01/02/2046 | 13 605 978  | 0,20             |                   |
| 6 712 000   | 4.700%           | Anheuser-Busch InBev Finance Inc 01/02/2036                            | 6 641 188   | 0,10             |                   |
| 1 349 000   | 4.625%           | Anheuser-Busch InBev Finance Inc 01/02/2044                            | 1 271 190   | 0,02             |                   |
| 14 379 000  | 4.900%           | Anheuser-Busch InBev Finance Inc 01/02/2046                            | 14 001 324  | 0,20             |                   |
| 1 020 000   | 4.000%           | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 13/04/2028                          | 1 005 434   | 0,01             |                   |
| 9 859 000   | 4.750%           | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 23/01/2029                          | 10 070 771  | 0,15             |                   |
| 443 000   | 3.500%           | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 01/06/2030                          | 417 869   | 0,01             |                   |
| 876 000   | 4.900%           | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 23/01/2031                          | 906 555   | 0,01             |                   |
| 200 000   | 5.875%           | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 15/06/2035                          | 217 724   | 0,00             |                   |
| 3 492 000   | 4.375%           | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 15/04/2038                          | 3 312 406   | 0,05             |                   |
| 480 000   | 8.200%           | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 15/01/2039                          | 626 794   | 0,01             |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 2 096 000 5.450% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 23/01/2039          | 2 200 528        | 0,03              |
| 875 000 8.000% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 15/11/2039            | 1 125 381        | 0,02              |
| 6 098 000 4.350% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 01/06/2040          | 5 675 653        | 0,08              |
| 4 031 000 4.950% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 15/01/2042          | 3 984 684        | 0,06              |
| 4 239 000 4.600% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 15/04/2048          | 4 015 308        | 0,06              |
| 3 465 000 4.439% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 06/10/2048          | 3 190 329        | 0,05              |
| 7 560 000 5.550% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 23/01/2049          | 8 163 137        | 0,12              |
| 3 375 000 4.500% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 01/06/2050          | 3 157 312        | 0,05              |
| 2 212 000 5.800% Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 23/01/2059          | 2 428 533        | 0,04              |
| 150 000 3.400% Appalachian Power Co 01/06/2025                          | 145 307          | 0,00              |
| 1 315 000 4.500% Appalachian Power Co 01/08/2032                        | 1 262 781        | 0,02              |
| 832 000 7.000% Appalachian Power Co 01/04/2038                          | 963 722          | 0,01              |
| 490 000 4.400% Appalachian Power Co 15/05/2044                          | 421 655          | 0,01              |
| 820 000 4.450% Appalachian Power Co 01/06/2045                          | 700 362          | 0,01              |
| 2 018 000 4.500% Appalachian Power Co 01/03/2049                        | 1 741 615        | 0,03              |
| 600 000 3.700% Appalachian Power Co 01/05/2050                          | 460 962          | 0,01              |
| 3 740 000 3.450% Apple Inc 06/05/2024                                   | 3 697 140        | 0,05              |
| 7 367 000 2.850% Apple Inc 11/05/2024                                   | 7 242 645        | 0,11              |
| 356 000 1.800% Apple Inc 11/09/2024                                     | 343 366          | 0,01              |
| 1 341 000 2.750% Apple Inc 13/01/2025                                   | 1 306 711        | 0,02              |
| 5 220 000 2.500% Apple Inc 09/02/2025                                   | 5 064 183        | 0,07              |
| 2 456 000 1.125% Apple Inc 11/05/2025                                   | 2 304 588        | 0,03              |
| 6 013 000 3.200% Apple Inc 13/05/2025                                   | 5 899 294        | 0,09              |
| 1 000 000 0.550% Apple Inc 20/08/2025                                   | 921 660          | 0,01              |
| 2 250 000 0.700% Apple Inc 08/02/2026                                   | 2 047 027        | 0,03              |
| 6 227 000 3.250% Apple Inc 23/02/2026                                   | 6 093 555        | 0,09              |
| 3 657 000 2.450% Apple Inc 04/08/2026                                   | 3 482 671        | 0,05              |
| 2 733 000 2.050% Apple Inc 11/09/2026                                   | 2 555 109        | 0,04              |
| 3 133 000 3.350% Apple Inc 09/02/2027                                   | 3 058 372        | 0,04              |
| 4 283 000 3.200% Apple Inc 11/05/2027                                   | 4 173 655        | 0,06              |
| 50 000 3.000% Apple Inc 20/06/2027                                      | 48 296           | 0,00              |
| 3 460 000 2.900% Apple Inc 12/09/2027                                   | 3 311 635        | 0,05              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 2 011 000 3.000% Apple Inc 13/11/2027                                   | 1 930 721        | 0,03              |
| 1 310 000 1.200% Apple Inc 08/02/2028                                   | 1 151 804        | 0,02              |
| 2 500 000 1.400% Apple Inc 05/08/2028                                   | 2 191 000        | 0,03              |
| 1 000 000 3.250% Apple Inc 08/08/2029                                   | 956 760          | 0,01              |
| 3 507 000 2.200% Apple Inc 11/09/2029                                   | 3 138 204        | 0,05              |
| 1 504 000 1.650% Apple Inc 11/05/2030                                   | 1 279 844        | 0,02              |
| 1 832 000 1.250% Apple Inc 20/08/2030                                   | 1 500 445        | 0,02              |
| 3 000 000 1.650% Apple Inc 08/02/2031                                   | 2 507 370        | 0,04              |
| 125 000 1.700% Apple Inc 05/08/2031                                     | 103 955          | 0,00              |
| 1 000 000 3.350% Apple Inc 08/08/2032                                   | 944 140          | 0,01              |
| 1 757 000 4.500% Apple Inc 23/02/2036                                   | 1 815 526        | 0,03              |
| 3 500 000 2.375% Apple Inc 08/02/2041                                   | 2 622 515        | 0,04              |
| 5 054 000 3.850% Apple Inc 04/05/2043                                   | 4 603 739        | 0,07              |
| 1 030 000 4.450% Apple Inc 06/05/2044                                   | 1 030 474        | 0,02              |
| 4 382 000 3.450% Apple Inc 09/02/2045                                   | 3 763 875        | 0,06              |
| 3 366 000 4.375% Apple Inc 13/05/2045                                   | 3 265 861        | 0,05              |
| 16 917 000 4.650% Apple Inc 23/02/2046                                  | 16 972 319       | 0,25              |
| 5 428 000 3.850% Apple Inc 04/08/2046                                   | 4 840 853        | 0,07              |
| 14 345 000 4.250% Apple Inc 09/02/2047                                  | 13 764 888       | 0,20              |
| 2 570 000 3.750% Apple Inc 12/09/2047                                   | 2 245 897        | 0,03              |
| 10 783 000 3.750% Apple Inc 13/11/2047                                  | 9 432 778        | 0,14              |
| 5 867 000 2.950% Apple Inc 11/09/2049                                   | 4 433 868        | 0,06              |
| 5 689 000 2.650% Apple Inc 11/05/2050                                   | 4 021 213        | 0,06              |
| 240 000 2.400% Apple Inc 20/08/2050                                     | 160 471          | 0,00              |
| 7 000 000 2.650% Apple Inc 08/02/2051                                   | 4 908 820        | 0,07              |
| 6 100 000 2.700% Apple Inc 05/08/2051                                   | 4 295 803        | 0,06              |
| 1 225 000 3.950% Apple Inc 08/08/2052                                   | 1 098 053        | 0,02              |
| 17 927 000 2.550% Apple Inc 20/08/2060                                  | 11 880 967       | 0,17              |
| 26 122 000 2.800% Apple Inc 08/02/2061                                  | 17 788 145       | 0,26              |
| 20 000 000 2.850% Apple Inc 05/08/2061                                  | 13 788 904       | 0,20              |
| 2 200 000 4.100% Apple Inc 08/08/2062                                   | 1 959 689        | 0,03              |
| 538 000 3.900% Applied Materials Inc 01/10/2025                         | 530 823          | 0,01              |
| 73 000 3.300% Applied Materials Inc 01/04/2027                          | 70 523           | 0,00              |
| 714 000 1.750% Applied Materials Inc 01/06/2030                         | 599 739          | 0,01              |
| 14 000 5.100% Applied Materials Inc 01/10/2035                          | 14 590           | 0,00              |
| 693 000 5.850% Applied Materials Inc 15/06/2041                         | 768 010          | 0,01              |
| 3 386 000 4.350% Applied Materials Inc 01/04/2047                       | 3 169 161        | 0,05              |
| 275 000 2.750% Applied Materials Inc 01/06/2050                         | 196 851          | 0,00              |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Partici-<br>pation Investissement                                       | Juste<br>valeur<br>USD | % des<br>actifs<br>nets | Partici-<br>pation Investissement                                       | Juste<br>valeur<br>USD | % des<br>actifs<br>nets |
|---|------------------------|-------------------------|---|------------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                        |                         | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                        |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                        |                         | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                        |                         |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                        |                         | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                        |                         |
| 2 000 000 4.350% Aptiv PLC 15/03/2029                                   | 1 930 100              | 0,03                    | 1 507 000 4.000% AstraZeneca PLC 17/01/2029                             | 1 485 043              | 0,02                    |
| 500 000 4.400% Aptiv PLC 01/10/2046                                     | 396 430                | 0,01                    | 367 000 1.375% AstraZeneca PLC 06/08/2030                               | 299 277                | 0,00                    |
| 200 000 5.400% Aptiv PLC 15/03/2049                                     | 177 362                | 0,00                    | 5 003 000 6.450% AstraZeneca PLC 15/09/2037                             | 5 900 038              | 0,09                    |
| 1 500 000 3.100% Aptiv PLC 01/12/2051                                   | 951 135                | 0,01                    | 1 896 000 4.000% AstraZeneca PLC 18/09/2042                             | 1 724 621              | 0,03                    |
| 1 000 000 2.396% Aptiv PLC / Aptiv Corp 18/02/2025                      | 952 050                | 0,01                    | 582 000 4.375% AstraZeneca PLC 16/11/2045                               | 559 523                | 0,01                    |
| 1 050 000 3.250% Aptiv PLC / Aptiv Corp 01/03/2032                      | 915 170                | 0,01                    | 2 145 000 4.375% AstraZeneca PLC 17/08/2048                             | 2 035 283              | 0,03                    |
| 1 000 000 4.150% Aptiv PLC / Aptiv Corp 01/05/2052                      | 781 590                | 0,01                    | 250 000 2.125% AstraZeneca PLC 06/08/2050                               | 158 093                | 0,00                    |
| 830 000 4.550% ArcelorMittal SA 11/03/2026                              | 814 047                | 0,01                    | 522 000 3.875% AT&T Inc 15/01/2026                                      | 512 943                | 0,01                    |
| 2 000 000 6.550% ArcelorMittal SA 29/11/2027                            | 2 085 260              | 0,03                    | 3 850 000 5.539% AT&T Inc 20/02/2026                                    | 3 859 894              | 0,06                    |
| 500 000 4.250% ArcelorMittal SA 16/07/2029                              | 474 265                | 0,01                    | 5 100 000 1.700% AT&T Inc 25/03/2026                                    | 4 680 933              | 0,07                    |
| 1 765 000 6.800% ArcelorMittal SA 29/11/2032                            | 1 852 509              | 0,03                    | 1 015 000 2.950% AT&T Inc 15/07/2026                                    | 954 770                | 0,01                    |
| 950 000 7.000% ArcelorMittal SA 15/10/2039                              | 1 000 398              | 0,01                    | 2 619 000 3.800% AT&T Inc 15/02/2027                                    | 2 534 118              | 0,04                    |
| 330 000 6.750% ArcelorMittal SA 01/03/2041                              | 334 211                | 0,00                    | 1 270 000 4.250% AT&T Inc 01/03/2027                                    | 1 258 392              | 0,02                    |
| 30 000 3.150% Arizona Public Service Co 15/05/2025                      | 28 817                 | 0,00                    | 2 691 000 2.300% AT&T Inc 01/06/2027                                    | 2 465 575              | 0,04                    |
| 625 000 2.600% Arizona Public Service Co 15/08/2029                     | 543 200                | 0,01                    | 7 550 000 1.650% AT&T Inc 01/02/2028                                    | 6 629 881              | 0,10                    |
| 1 000 000 2.200% Arizona Public Service Co 15/12/2031                   | 794 630                | 0,01                    | 3 450 000 4.100% AT&T Inc 15/02/2028                                    | 3 368 994              | 0,05                    |
| 2 000 000 6.350% Arizona Public Service Co 15/12/2032                   | 2 175 480              | 0,03                    | 4 658 000 4.350% AT&T Inc 01/03/2029                                    | 4 561 207              | 0,07                    |
| 119 000 5.050% Arizona Public Service Co 01/09/2041                     | 110 281                | 0,00                    | 2 951 000 4.300% AT&T Inc 15/02/2030                                    | 2 869 464              | 0,04                    |
| 585 000 4.500% Arizona Public Service Co 01/04/2042                     | 511 547                | 0,01                    | 3 501 000 2.750% AT&T Inc 01/06/2031                                    | 3 013 696              | 0,04                    |
| 1 090 000 4.350% Arizona Public Service Co 15/11/2045                   | 901 692                | 0,01                    | 2 642 000 2.250% AT&T Inc 01/02/2032                                    | 2 157 616              | 0,03                    |
| 148 000 3.750% Arizona Public Service Co 15/05/2046                     | 113 312                | 0,00                    | 7 805 000 2.550% AT&T Inc 01/12/2033                                    | 6 278 420              | 0,09                    |
| 2 092 000 4.200% Arizona Public Service Co 15/08/2048                   | 1 699 164              | 0,02                    | 5 041 000 4.500% AT&T Inc 15/05/2035                                    | 4 727 248              | 0,07                    |
| 1 165 000 3.350% Arizona Public Service Co 15/05/2050                   | 822 199                | 0,01                    | 3 630 000 5.250% AT&T Inc 01/03/2037                                    | 3 624 228              | 0,05                    |
| 2 400 000 0.700% Astrazeneca Finance LLC 28/05/2024                     | 2 294 712              | 0,03                    | 6 551 000 4.900% AT&T Inc 15/08/2037                                    | 6 248 802              | 0,09                    |
| 165 000 1.200% Astrazeneca Finance LLC 28/05/2026                       | 150 280                | 0,00                    | 150 000 6.300% AT&T Inc 15/01/2038                                      | 165 299                | 0,00                    |
| 1 500 000 4.875% Astrazeneca Finance LLC 03/03/2028                     | 1 545 255              | 0,02                    | 5 413 000 4.850% AT&T Inc 01/03/2039                                    | 5 077 232              | 0,07                    |
| 1 000 000 2.250% Astrazeneca Finance LLC 28/05/2031                     | 859 310                | 0,01                    | 1 000 000 6.000% AT&T Inc 15/08/2040                                    | 1 047 110              | 0,02                    |
| 1 500 000 4.875% Astrazeneca Finance LLC 03/03/2033                     | 1 550 130              | 0,02                    | 4 250 000 5.350% AT&T Inc 01/09/2040                                    | 4 210 177              | 0,06                    |
| 3 433 000 3.375% AstraZeneca PLC 16/11/2025                             | 3 365 576              | 0,05                    | 4 759 000 3.500% AT&T Inc 01/06/2041                                    | 3 756 374              | 0,06                    |
| 2 032 000 0.700% AstraZeneca PLC 08/04/2026                             | 1 829 003              | 0,03                    | 150 000 5.150% AT&T Inc 15/03/2042                                      | 143 807                | 0,00                    |
| 847 000 3.125% AstraZeneca PLC 12/06/2027                               | 808 707                | 0,01                    | 4 155 000 4.300% AT&T Inc 15/12/2042                                    | 3 618 506              | 0,05                    |
|   |                        |                         | 6 599 000 3.100% AT&T Inc 01/02/2043                                    | 4 872 702              | 0,07                    |
|   |                        |                         | 3 004 000 4.650% AT&T Inc 01/06/2044                                    | 2 675 813              | 0,04                    |
|   |                        |                         | 5 660 000 4.350% AT&T Inc 15/06/2045                                    | 4 827 980              | 0,07                    |
|   |                        |                         | 1 000 000 4.850% AT&T Inc 15/07/2045                                    | 904 980                | 0,01                    |
|   |                        |                         | 4 565 000 4.750% AT&T Inc 15/05/2046                                    | 4 108 774              | 0,06                    |
|   |                        |                         | 2 000 000 5.150% AT&T Inc 15/11/2046                                    | 1 928 900              | 0,03                    |
|   |                        |                         | 1 000 000 5.450% AT&T Inc 01/03/2047                                    | 997 280                | 0,01                    |
|   |                        |                         | 6 948 000 4.500% AT&T Inc 09/03/2048                                    | 5 987 022              | 0,09                    |
|   |                        |                         | 3 375 000 4.550% AT&T Inc 09/03/2049                                    | 2 934 394              | 0,04                    |
|   |                        |                         | 1 010 000 5.150% AT&T Inc 15/02/2050                                    | 961 853                | 0,01                    |
|   |                        |                         | 3 750 000 3.650% AT&T Inc 01/06/2051                                    | 2 838 412              | 0,04                    |
|   |                        |                         | 9 119 000 3.500% AT&T Inc 15/09/2053                                    | 6 621 944              | 0,10                    |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>                  |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>                   |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>            |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>             |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>  |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 10 319 000 3.550% AT&T Inc 15/09/2055  | 7 412 447        | 0,11              | 7 058 000 3.900% AvalonBay Communities Inc 15/10/2046                               | 5 546 459        | 0,08              |
| 6 869 000 3.800% AT&T Inc 01/12/2057   | 5 102 293        | 0,07              | 4 620 000 4.150% AvalonBay Communities Inc 01/07/2047                               | 3 799 580        | 0,06              |
| 12 309 000 3.650% AT&T Inc 15/09/2059  | 8 794 904        | 0,13              | 3 110 000 4.350% AvalonBay Communities Inc 15/04/2048                               | 2 647 263        | 0,04              |
| 1 340 000 3.850% AT&T Inc 01/06/2060   | 1 004 263        | 0,01              | 16 287 000 8.600% AXA SA 15/12/2030   | 19 564 922       | 0,29              |
| 1 500 000 3.500% AT&T Inc 01/02/2061   | 1 055 340        | 0,02              | 2 007 000 5.125% Baker Hughes Holdings LLC 15/09/2040                               | 1 946 690        | 0,03              |
| 1 060 000 4.000% Atlantic City Electric Co 15/10/2028                              | 1 030 765        | 0,02              | 50 000 2.061% Baker Hughes Holdings LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc 15/12/2026    | 45 335           | 0,00              |
| 1 500 000 2.300% Atlantic City Electric Co 15/03/2031                              | 1 265 670        | 0,02              | 1 538 000 3.337% Baker Hughes Holdings LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc 15/12/2027 | 1 441 275        | 0,02              |
| 11 325 000 3.700% Australia & New Zealand Banking Group Ltd/New York NY 16/11/2025 | 11 044 933       | 0,16              | 20 000 3.138% Baker Hughes Holdings LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc 07/11/2029    | 17 954           | 0,00              |
| 20 700 000 5.088% Australia & New Zealand Banking Group Ltd/New York NY 08/12/2025 | 20 880 297       | 0,31              | 1 230 000 4.486% Baker Hughes Holdings LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc 01/05/2030 | 1 203 863        | 0,02              |
| 1 308 000 4.375% Autodesk Inc 15/06/2025   | 1 294 711        | 0,02              | 250 000 4.080% Baker Hughes Holdings LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc 15/12/2047   | 203 270          | 0,00              |
| 2 592 000 3.500% Autodesk Inc 15/06/2027   | 2 485 728        | 0,04              | 10 000 2.400% Baltimore Gas and Electric Co 15/08/2026                              | 9 341            | 0,00              |
| 1 151 000 3.375% Automatic Data Processing Inc 15/09/2025                          | 1 129 085        | 0,02              | 3 900 000 2.250% Baltimore Gas and Electric Co 15/06/2031                           | 3 284 541        | 0,05              |
| 1 165 000 1.700% Automatic Data Processing Inc 15/05/2028                          | 1 040 322        | 0,02              | 564 000 6.350% Baltimore Gas and Electric Co 01/10/2036                             | 629 119          | 0,01              |
| 1 400 000 1.250% Automatic Data Processing Inc 01/09/2030                          | 1 147 636        | 0,02              | 1 345 000 3.200% Baltimore Gas and Electric Co 15/09/2049                           | 994 587          | 0,01              |
| 500 000 3.500% AvalonBay Communities Inc 15/11/2024                                | 486 670          | 0,01              | 217 000 2.900% Baltimore Gas and Electric Co 15/06/2050                             | 149 632          | 0,00              |
| 933 000 3.450% AvalonBay Communities Inc 01/06/2025                                | 900 690          | 0,01              | 1 000 000 4.550% Baltimore Gas and Electric Co 01/06/2052                           | 910 760          | 0,01              |
| 6 405 000 3.500% AvalonBay Communities Inc 15/11/2025                              | 6 173 844        | 0,09              | 11 206 000 1.125% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 18/09/2025                     | 10 134 370       | 0,15              |
| 5 954 000 2.950% AvalonBay Communities Inc 11/05/2026                              | 5 610 811        | 0,08              | 16 500 000 5.862% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 14/09/2026                     | 16 300 845       | 0,24              |
| 2 000 000 2.900% AvalonBay Communities Inc 15/10/2026                              | 1 884 420        | 0,03              | 12 600 000 6.138% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 14/09/2028                     | 12 823 146       | 0,19              |
| 4 700 000 3.350% AvalonBay Communities Inc 15/05/2027                              | 4 426 178        | 0,06              | 4 000 000 3.892% Banco Santander SA 24/05/2024                                      | 3 917 320        | 0,06              |
| 5 509 000 3.200% AvalonBay Communities Inc 15/01/2028                              | 5 141 990        | 0,08              | 915 000 2.706% Banco Santander SA 27/06/2024  | 883 853          | 0,01              |
| 3 950 000 1.900% AvalonBay Communities Inc 01/12/2028                              | 3 409 205        | 0,05              | 1 400 000 3.496% Banco Santander SA 24/03/2025                                      | 1 345 078        | 0,02              |
| 4 347 000 3.300% AvalonBay Communities Inc 01/06/2029                              | 3 939 903        | 0,06              | 3 734 000 2.746% Banco Santander SA 28/05/2025                                      | 3 513 545        | 0,05              |
| 14 666 000 2.300% AvalonBay Communities Inc 01/03/2030                             | 12 448 984       | 0,18              | 1 570 000 5.147% Banco Santander SA 18/08/2025                                      | 1 542 139        | 0,02              |
| 7 250 000 2.450% AvalonBay Communities Inc 15/01/2031                              | 6 108 850        | 0,09              |   |                  |                   |
| 9 600 000 2.050% AvalonBay Communities Inc 15/01/2032                              | 7 718 304        | 0,11              |   |                  |                   |
| 8 900 000 5.000% AvalonBay Communities Inc 15/02/2033                              | 9 031 132        | 0,13              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets                          | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|--|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |  | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |  | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |  | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 3 200 000   | 5.179%           | Banco Santander SA<br>19/11/2025           | 3 136 288   | 0,05             |                   |
| 2 182 000   | 4.250%           | Banco Santander SA<br>11/04/2027           | 2 059 612   | 0,03             |                   |
| 725 000   | 5.294%           | Banco Santander SA<br>18/08/2027           | 714 161   | 0,01             |                   |
| 1 200 000   | 1.722%           | Banco Santander SA<br>14/09/2027           | 1 045 188   | 0,02             |                   |
| 417 000   | 3.800%           | Banco Santander SA<br>23/02/2028           | 384 954   | 0,01             |                   |
| 2 680 000   | 4.175%           | Banco Santander SA<br>24/03/2028           | 2 510 619   | 0,04             |                   |
| 1 345 000   | 4.379%           | Banco Santander SA<br>12/04/2028           | 1 273 621   | 0,02             |                   |
| 560 000   | 3.306%           | Banco Santander SA<br>27/06/2029           | 501 066   | 0,01             |                   |
| 1 700 000   | 3.490%           | Banco Santander SA<br>28/05/2030           | 1 489 693   | 0,02             |                   |
| 3 615 000   | 2.749%           | Banco Santander SA<br>03/12/2030           | 2 826 894   | 0,04             |                   |
| 1 200 000   | 2.958%           | Banco Santander SA<br>25/03/2031           | 985 536   | 0,01             |                   |
| 3 350 000   | 3.225%           | Banco Santander SA<br>22/11/2032           | 2 605 529   | 0,04             |                   |
| 5 219 000   | 2.500%           | Bank of Montreal 28/06/2024                | 5 046 669   | 0,07             |                   |
| 17 400 000  | 0.625%           | Bank of Montreal 09/07/2024                | 16 445 262  | 0,24             |                   |
| 1 000 000   | 4.250%           | Bank of Montreal 14/09/2024                | 987 570   | 0,01             |                   |
| 4 015 000   | 5.200%           | Bank of Montreal 12/12/2024                | 4 019 004   | 0,06             |                   |
| 3 050 000   | 1.500%           | Bank of Montreal 10/01/2025                | 2 868 098   | 0,04             |                   |
| 23 356 000  | 1.850%           | Bank of Montreal 01/05/2025                | 21 884 572  | 0,32             |                   |
| 3 255 000   | 3.700%           | Bank of Montreal 07/06/2025                | 3 164 251   | 0,05             |                   |
| 20 421 000  | 1.250%           | Bank of Montreal 15/09/2026                | 18 054 819  | 0,26             |                   |
| 15 185 000  | 0.949%           | Bank of Montreal 22/01/2027                | 13 564 457  | 0,20             |                   |
| 12 250 000  | 2.650%           | Bank of Montreal 08/03/2027                | 11 318 045  | 0,17             |                   |
| 15 250 000  | 4.700%           | Bank of Montreal 14/09/2027                | 15 147 672  | 0,22             |                   |
| 3 500 000   | 5.203%           | Bank of Montreal 01/02/2028                | 3 526 415   | 0,05             |                   |
| 21 950 000  | 3.803%           | Bank of Montreal 15/12/2032                | 19 706 710  | 0,29             |                   |
| 18 850 000  | 3.088%           | Bank of Montreal 10/01/2037                | 15 060 220  | 0,22             |                   |
| 1 425 000   | 5.224%           | Bank of New York Mellon<br>21/11/2025      | 1 428 377   | 0,02             |                   |
| 600 000   | 0.500%           | Bank of New York Mellon Corp<br>26/04/2024 | 570 936   | 0,01             |                   |
| 1 794 000   | 3.250%           | Bank of New York Mellon Corp<br>11/09/2024 | 1 746 423   | 0,03             |                   |
| 849 000   | 2.100%           | Bank of New York Mellon Corp<br>24/10/2024 | 812 680   | 0,01             |                   |
| 2 572 000   | 3.000%           | Bank of New York Mellon Corp<br>24/02/2025 | 2 483 806   | 0,04             |                   |
| 1 161 000   | 1.600%           | Bank of New York Mellon Corp<br>24/04/2025 | 1 083 085   | 0,02             |                   |
| 2 000 000   | 3.350%           | Bank of New York Mellon Corp<br>25/04/2025 | 1 935 180   | 0,03             |                   |
| 1 000 000   | 3.430%           | Bank of New York Mellon Corp<br>13/06/2025 | 978 760   | 0,01             |                   |
| 1 005 000   | 3.950%           | Bank of New York Mellon Corp<br>18/11/2025 | 975 453   | 0,01             |                   |
| 506 000   | 0.750%           | Bank of New York Mellon Corp<br>28/01/2026 | 451 043   | 0,01             |                   |
| 582 000   | 2.800%           | Bank of New York Mellon Corp<br>04/05/2026 | 546 265   | 0,01             |                   |
| 920 000   | 4.414%           | Bank of New York Mellon Corp<br>24/07/2026 | 909 779   | 0,01             |                   |
| 161 000   | 2.450%           | Bank of New York Mellon Corp<br>17/08/2026 | 148 473   | 0,00             |                   |
| 3 000 000   | 1.050%           | Bank of New York Mellon Corp<br>15/10/2026 | 2 626 650   | 0,04             |                   |
| 638 000   | 3.250%           | Bank of New York Mellon Corp<br>16/05/2027 | 604 435   | 0,01             |                   |
| 127 000   | 3.400%           | Bank of New York Mellon Corp<br>29/01/2028 | 120 524   | 0,00             |                   |
| 2 670 000   | 3.442%           | Bank of New York Mellon Corp<br>07/02/2028 | 2 553 535   | 0,04             |                   |
| 861 000   | 3.850%           | Bank of New York Mellon Corp<br>28/04/2028 | 831 812   | 0,01             |                   |
| 500 000   | 3.992%           | Bank of New York Mellon Corp<br>13/06/2028 | 486 205   | 0,01             |                   |
| 1 300 000   | 1.650%           | Bank of New York Mellon Corp<br>14/07/2028 | 1 131 832   | 0,02             |                   |
| 910 000   | 5.802%           | Bank of New York Mellon Corp<br>25/10/2028 | 945 172   | 0,01             |                   |
| 500 000   | 4.543%           | Bank of New York Mellon Corp<br>01/02/2029 | 495 515   | 0,01             |                   |
| 2 000 000   | 3.850%           | Bank of New York Mellon Corp<br>26/04/2029 | 1 916 600   | 0,03             |                   |
| 305 000   | 3.300%           | Bank of New York Mellon Corp<br>23/08/2029 | 280 570   | 0,00             |                   |
| 425 000   | 4.596%           | Bank of New York Mellon Corp<br>26/07/2030 | 417 584   | 0,01             |                   |
| 290 000   | 1.650%           | Bank of New York Mellon Corp<br>28/01/2031 | 227 076   | 0,00             |                   |
| 500 000   | 4.289%           | Bank of New York Mellon Corp<br>13/06/2033 | 478 930   | 0,01             |                   |
| 585 000   | 5.834%           | Bank of New York Mellon Corp<br>25/10/2033 | 624 862   | 0,01             |                   |
| 515 000   | 4.706%           | Bank of New York Mellon Corp<br>01/02/2034 | 509 407   | 0,01             |                   |
| 1 500 000   | 0.700%           | Bank of Nova Scotia<br>15/04/2024          | 1 433 550   | 0,02             |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 200 000 0.650% Bank of Nova Scotia<br>31/07/2024                        | 188 628          | 0,00              | 400 000 2.645% Barclays PLC 24/06/2031                                  | 322 836          | 0,00              |
| 50 000 1.450% Bank of Nova Scotia<br>10/01/2025                         | 46 894           | 0,00              | 765 000 5.746% Barclays PLC 09/08/2033                                  | 749 616          | 0,01              |
| 3 332 000 2.200% Bank of Nova Scotia<br>03/02/2025                      | 3 167 632        | 0,05              | 1 000 000 7.437% Barclays PLC 02/11/2033                                | 1 104 370        | 0,02              |
| 1 200 000 3.450% Bank of Nova Scotia<br>11/04/2025                      | 1 163 940        | 0,02              | 3 670 000 3.564% Barclays PLC 23/09/2035                                | 2 882 601        | 0,04              |
| 2 097 000 1.300% Bank of Nova Scotia<br>11/06/2025                      | 1 934 357        | 0,03              | 2 000 000 3.330% Barclays PLC 24/11/2042                                | 1 437 200        | 0,02              |
| 19 649 000 4.500% Bank of Nova Scotia<br>16/12/2025                     | 19 256 806       | 0,28              | 1 684 000 5.250% Barclays PLC 17/08/2045                                | 1 594 900        | 0,02              |
| 1 400 000 4.750% Bank of Nova Scotia<br>02/02/2026                      | 1 391 894        | 0,02              | 2 224 000 4.950% Barclays PLC 10/01/2047                                | 1 998 420        | 0,03              |
| 110 000 1.050% Bank of Nova Scotia<br>02/03/2026                        | 98 529           | 0,00              | 250 000 6.450% Barrick Gold Corp 15/10/2035                             | 272 108          | 0,00              |
| 1 000 000 1.350% Bank of Nova Scotia<br>24/06/2026                      | 891 970          | 0,01              | 2 528 000 5.700% Barrick North America<br>Finance LLC 30/05/2041        | 2 656 852        | 0,04              |
| 3 429 000 2.700% Bank of Nova Scotia<br>03/08/2026                      | 3 185 027        | 0,05              | 524 000 5.750% Barrick North America<br>Finance LLC 01/05/2043          | 554 759          | 0,01              |
| 1 000 000 1.300% Bank of Nova Scotia<br>15/09/2026                      | 883 690          | 0,01              | 1 358 000 5.950% Barrick PD Australia Finance<br>Pty Ltd 15/10/2039     | 1 457 365        | 0,02              |
| 1 000 000 1.950% Bank of Nova Scotia<br>02/02/2027                      | 904 800          | 0,01              | 3 040 000 4.000% Baxalta Inc 23/06/2025                                 | 2 976 160        | 0,04              |
| 3 500 000 2.951% Bank of Nova Scotia<br>11/03/2027                      | 3 267 040        | 0,05              | 359 000 5.250% Baxalta Inc 23/06/2045                                   | 353 184          | 0,01              |
| 415 000 4.850% Bank of Nova Scotia<br>01/02/2030                        | 409 883          | 0,01              | 4 000 000 1.322% Baxter International Inc<br>29/11/2024                 | 3 764 240        | 0,06              |
| 1 500 000 2.450% Bank of Nova Scotia<br>02/02/2032                      | 1 239 060        | 0,02              | 6 557 000 2.600% Baxter International Inc<br>15/08/2026                 | 6 115 714        | 0,09              |
| 1 940 000 4.588% Bank of Nova Scotia<br>04/05/2037                      | 1 721 323        | 0,03              | 340 000 1.915% Baxter International Inc<br>01/02/2027                   | 304 283          | 0,00              |
| 500 000 3.750% Barclays Bank PLC 15/05/2024                             | 489 235          | 0,01              | 2 100 000 2.272% Baxter International Inc<br>01/12/2028                 | 1 824 144        | 0,03              |
| 5 100 000 4.375% Barclays PLC 11/09/2024                                | 4 917 063        | 0,07              | 2 152 000 3.950% Baxter International Inc<br>01/04/2030                 | 2 003 534        | 0,03              |
| 800 000 3.650% Barclays PLC 16/03/2025                                  | 763 304          | 0,01              | 7 295 000 1.730% Baxter International Inc<br>01/04/2031                 | 5 703 815        | 0,08              |
| 2 152 000 3.932% Barclays PLC 07/05/2025                                | 2 094 090        | 0,03              | 23 800 000 2.539% Baxter International Inc<br>01/02/2032                | 19 389 860       | 0,28              |
| 2 969 000 4.375% Barclays PLC 12/01/2026                                | 2 874 912        | 0,04              | 3 350 000 3.500% Baxter International Inc<br>15/08/2046                 | 2 368 249        | 0,03              |
| 1 828 000 2.852% Barclays PLC 07/05/2026                                | 1 708 175        | 0,03              | 11 700 000 3.132% Baxter International Inc<br>01/12/2051                | 7 581 483        | 0,11              |
| 3 474 000 5.200% Barclays PLC 12/05/2026                                | 3 325 382        | 0,05              | 4 953 000 3.363% Becton Dickinson and Co<br>06/06/2024                  | 4 861 914        | 0,07              |
| 1 515 000 5.304% Barclays PLC 09/08/2026                                | 1 485 139        | 0,02              | 7 654 000 3.734% Becton Dickinson and Co<br>15/12/2024                  | 7 497 705        | 0,11              |
| 1 000 000 7.325% Barclays PLC 02/11/2026                                | 1 028 390        | 0,02              | 2 333 000 3.700% Becton Dickinson and Co<br>06/06/2027                  | 2 255 078        | 0,03              |
| 4 310 000 2.279% Barclays PLC 24/11/2027                                | 3 788 964        | 0,06              | 1 500 000 4.693% Becton Dickinson and Co<br>13/02/2028                  | 1 506 660        | 0,02              |
| 500 000 4.337% Barclays PLC 10/01/2028                                  | 476 195          | 0,01              | 2 513 000 2.823% Becton Dickinson and Co<br>20/05/2030                  | 2 241 018        | 0,03              |
| 1 058 000 4.836% Barclays PLC 09/05/2028                                | 999 662          | 0,01              | 500 000 1.957% Becton Dickinson and Co<br>11/02/2031                    | 411 160          | 0,01              |
| 1 810 000 5.501% Barclays PLC 09/08/2028                                | 1 797 692        | 0,03              | 855 000 4.298% Becton Dickinson and Co<br>22/08/2032                    | 828 247          | 0,01              |
| 400 000 7.385% Barclays PLC 02/11/2028                                  | 423 540          | 0,01              |   |                  |                   |
| 3 061 000 4.972% Barclays PLC 16/05/2029                                | 2 952 488        | 0,04              |   |                  |                   |
| 2 334 000 5.088% Barclays PLC 20/06/2030                                | 2 176 152        | 0,03              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets  | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|--|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |  | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |  | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |  | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 14 262 000  | 4.685%           | Becton Dickinson and Co<br>15/12/2044                    | 13 275 640  | 0,19             |                   |
| 21 413 000  | 4.669%           | Becton Dickinson and Co<br>06/06/2047                    | 19 969 336  | 0,29             |                   |
| 2 614 000   | 3.794%           | Becton Dickinson and Co<br>20/05/2050                    | 2 118 908   | 0,03             |                   |
| 350 000   | 0.750%           | Bell Telephone Co of Canada or<br>Bell Canada 17/03/2024 | 334 492   | 0,00             |                   |
| 4 000 000   | 2.150%           | Bell Telephone Co of Canada or<br>Bell Canada 15/02/2032 | 3 275 640   | 0,05             |                   |
| 852 000   | 4.464%           | Bell Telephone Co of Canada or<br>Bell Canada 01/04/2048 | 747 903   | 0,01             |                   |
| 100 000   | 4.300%           | Bell Telephone Co of Canada or<br>Bell Canada 29/07/2049 | 85 627  | 0,00             |                   |
| 864 000   | 3.650%           | Bell Telephone Co of Canada or<br>Bell Canada 17/03/2051 | 661 340   | 0,01             |                   |
| 255 000   | 3.200%           | Bell Telephone Co of Canada or<br>Bell Canada 15/02/2052 | 178 102   | 0,00             |                   |
| 4 840 000   | 7.250%           | Bestfoods 15/12/2026                                     | 5 271 534   | 0,08             |                   |
| 348 000   | 6.420%           | BHP Billiton Finance USA Ltd<br>01/03/2026               | 364 095   | 0,01             |                   |
| 100 000   | 4.125%           | BHP Billiton Finance USA Ltd<br>24/02/2042               | 90 598  | 0,00             |                   |
| 5 503 000   | 5.000%           | BHP Billiton Finance USA Ltd<br>30/09/2043               | 5 565 734   | 0,08             |                   |
| 1 861 000   | 4.050%           | Biogen Inc 15/09/2025                                    | 1 818 532   | 0,03             |                   |
| 1 486 000   | 2.250%           | Biogen Inc 01/05/2030                                    | 1 250 692   | 0,02             |                   |
| 970 000   | 5.200%           | Biogen Inc 15/09/2045                                    | 987 033   | 0,01             |                   |
| 1 700 000   | 3.150%           | Biogen Inc 01/05/2050                                    | 1 185 512   | 0,02             |                   |
| 3 916 000   | 3.250%           | Biogen Inc 15/02/2051                                    | 2 761 916   | 0,04             |                   |
| 1 361 000   | 3.200%           | BlackRock Inc 15/03/2027                                 | 1 310 956   | 0,02             |                   |
| 879 000   | 3.250%           | BlackRock Inc 30/04/2029                                 | 836 861   | 0,01             |                   |
| 1 042 000   | 2.400%           | BlackRock Inc 30/04/2030                                 | 914 866   | 0,01             |                   |
| 1 912 000   | 1.900%           | BlackRock Inc 28/01/2031                                 | 1 602 619   | 0,02             |                   |
| 1 200 000   | 2.100%           | BlackRock Inc 25/02/2032                                 | 1 002 768   | 0,01             |                   |
| 16 907 000  | 4.250%           | BNP Paribas SA 15/10/2024                                | 16 411 794  | 0,24             |                   |
| 14 736 000  | 3.200%           | Boston Properties LP<br>15/01/2025                       | 13 678 250  | 0,20             |                   |
| 13 787 000  | 3.650%           | Boston Properties LP<br>01/02/2026                       | 12 649 159  | 0,19             |                   |
| 17 320 000  | 2.750%           | Boston Properties LP<br>01/10/2026                       | 14 945 082  | 0,22             |                   |
| 10 100 000  | 6.750%           | Boston Properties LP<br>01/12/2027                       | 10 005 363  | 0,15             |                   |
| 20 070 000  | 4.500%           | Boston Properties LP<br>01/12/2028                       | 17 507 462  | 0,26             |                   |
| 13 874 000  | 3.400%           | Boston Properties LP<br>21/06/2029                       | 11 318 548  | 0,17             |                   |
| 14 124 000  | 2.900%           | Boston Properties LP<br>15/03/2030                       | 10 907 683  | 0,16             |                   |
| 21 424 000  | 3.250%           | Boston Properties LP<br>30/01/2031                       | 16 896 466  | 0,25             |                   |
| 16 100 000  | 2.550%           | Boston Properties LP<br>01/04/2032                       | 11 458 692  | 0,17             |                   |
| 13 500 000  | 2.450%           | Boston Properties LP<br>01/10/2033                       | 9 064 845   | 0,13             |                   |
| 1 000 000   | 3.796%           | BP Capital Markets America Inc<br>21/09/2025             | 992 770   | 0,01             |                   |
| 4 000 000   | 3.410%           | BP Capital Markets America Inc<br>11/02/2026             | 3 896 720   | 0,06             |                   |
| 1 000 000   | 3.119%           | BP Capital Markets America Inc<br>04/05/2026             | 962 130   | 0,01             |                   |
| 1 500 000   | 3.017%           | BP Capital Markets America Inc<br>16/01/2027             | 1 424 700   | 0,02             |                   |
| 500 000   | 3.543%           | BP Capital Markets America Inc<br>06/04/2027             | 484 440   | 0,01             |                   |
| 700 000   | 3.588%           | BP Capital Markets America Inc<br>14/04/2027             | 678 510   | 0,01             |                   |
| 1 000 000   | 3.937%           | BP Capital Markets America Inc<br>21/09/2028             | 978 800   | 0,01             |                   |
| 3 900 000   | 4.234%           | BP Capital Markets America Inc<br>06/11/2028             | 3 865 407   | 0,06             |                   |
| 2 000 000   | 2.721%           | BP Capital Markets America Inc<br>12/01/2032             | 1 745 380   | 0,03             |                   |
| 1 680 000   | 4.812%           | BP Capital Markets America Inc<br>13/02/2033             | 1 705 906   | 0,03             |                   |
| 1 500 000   | 3.060%           | BP Capital Markets America Inc<br>17/06/2041             | 1 160 070   | 0,02             |                   |
| 2 400 000   | 3.000%           | BP Capital Markets America Inc<br>24/02/2050             | 1 700 736   | 0,02             |                   |
| 1 000 000   | 2.772%           | BP Capital Markets America Inc<br>10/11/2050             | 673 240   | 0,01             |                   |
| 1 100 000   | 2.939%           | BP Capital Markets America Inc<br>04/06/2051             | 763 114   | 0,01             |                   |
| 1 400 000   | 3.001%           | BP Capital Markets America Inc<br>17/03/2052             | 983 948   | 0,01             |                   |
| 2 600 000   | 3.379%           | BP Capital Markets America Inc<br>08/02/2061             | 1 873 690   | 0,03             |                   |
| 2 000 000   | 3.279%           | BP Capital Markets PLC<br>19/09/2027                     | 1 923 160   | 0,03             |                   |
| 429 000   | 5.125%           | British Telecommunications PLC<br>04/12/2028             | 432 955   | 0,01             |                   |
| 20 371 000  | 9.625%           | British Telecommunications PLC<br>15/12/2030             | 25 487 788  | 0,37             |                   |
| 271 000   | 3.650%           | Brixmor Operating<br>Partnership LP 15/06/2024           | 262 656   | 0,00             |                   |
| 366 000   | 3.850%           | Brixmor Operating<br>Partnership LP 01/02/2025           | 350 807   | 0,01             |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 662 000 4.125% Brixmor Operating Partnership LP 15/06/2026              | 626 298          | 0,01              | 1 021 000 3.650% Canadian National Railway Co 03/02/2048                | 845 398          | 0,01              |
| 297 000 3.900% Brixmor Operating Partnership LP 15/03/2027              | 275 105          | 0,00              | 2 500 000 4.450% Canadian National Railway Co 20/01/2049                | 2 336 450        | 0,03              |
| 1 267 000 4.125% Brixmor Operating Partnership LP 15/05/2029            | 1 155 757        | 0,02              | 1 500 000 4.400% Canadian National Railway Co 05/08/2052                | 1 407 180        | 0,02              |
| 3 679 000 4.050% Brixmor Operating Partnership LP 01/07/2030            | 3 295 354        | 0,05              | 500 000 3.800% Canadian Natural Resources Ltd 15/04/2024                | 492 200          | 0,01              |
| 1 550 000 2.400% Brunswick Corp/DE 18/08/2031                           | 1 174 435        | 0,02              | 3 620 000 3.900% Canadian Natural Resources Ltd 01/02/2025              | 3 543 835        | 0,05              |
| 2 000 000 4.400% Brunswick Corp/DE 15/09/2032                           | 1 746 640        | 0,03              | 640 000 2.050% Canadian Natural Resources Ltd 15/07/2025                | 599 686          | 0,01              |
| 1 800 000 5.100% Brunswick Corp/DE 01/04/2052                           | 1 328 256        | 0,02              | 2 450 000 3.850% Canadian Natural Resources Ltd 01/06/2027              | 2 345 458        | 0,03              |
| 1 390 000 7.200% Burlington Resources LLC 15/08/2031                    | 1 614 568        | 0,02              | 600 000 2.950% Canadian Natural Resources Ltd 15/07/2030                | 521 580          | 0,01              |
| 2 200 000 5.000% Cabot Corp 30/06/2032                                  | 2 146 320        | 0,03              | 200 000 6.500% Canadian Natural Resources Ltd 15/02/2037                | 209 330          | 0,00              |
| 12 224 000 3.950% Campbell Soup Co 15/03/2025                           | 12 005 068       | 0,18              | 1 200 000 6.250% Canadian Natural Resources Ltd 15/03/2038              | 1 254 216        | 0,02              |
| 5 130 000 3.300% Campbell Soup Co 19/03/2025                            | 4 973 176        | 0,07              | 500 000 6.750% Canadian Natural Resources Ltd 01/02/2039                | 533 670          | 0,01              |
| 12 342 000 4.150% Campbell Soup Co 15/03/2028                           | 12 089 483       | 0,18              | 825 000 1.350% Canadian Pacific Railway Co 02/12/2024                   | 777 629          | 0,01              |
| 6 828 000 2.375% Campbell Soup Co 24/04/2030                            | 5 851 391        | 0,09              | 2 023 000 2.900% Canadian Pacific Railway Co 01/02/2025                 | 1 947 926        | 0,03              |
| 8 632 000 4.800% Campbell Soup Co 15/03/2048                            | 8 048 736        | 0,12              | 1 675 000 1.750% Canadian Pacific Railway Co 02/12/2026                 | 1 521 503        | 0,02              |
| 4 332 000 3.125% Campbell Soup Co 24/04/2050                            | 3 065 800        | 0,04              | 3 196 000 2.050% Canadian Pacific Railway Co 05/03/2030                 | 2 715 929        | 0,04              |
| 1 832 000 3.100% Canadian Imperial Bank of Commerce 02/04/2024          | 1 790 194        | 0,03              | 4 950 000 2.450% Canadian Pacific Railway Co 02/12/2031                 | 4 285 165        | 0,06              |
| 1 723 000 2.250% Canadian Imperial Bank of Commerce 28/01/2025          | 1 638 435        | 0,02              | 1 000 000 4.800% Canadian Pacific Railway Co 15/09/2035                 | 993 730          | 0,01              |
| 350 000 3.300% Canadian Imperial Bank of Commerce 07/04/2025            | 338 685          | 0,01              | 304 000 5.950% Canadian Pacific Railway Co 15/05/2037                   | 325 937          | 0,00              |
| 2 850 000 3.945% Canadian Imperial Bank of Commerce 04/08/2025          | 2 779 120        | 0,04              | 2 148 000 3.000% Canadian Pacific Railway Co 02/12/2041                 | 1 713 717        | 0,03              |
| 1 239 000 0.950% Canadian Imperial Bank of Commerce 23/10/2025          | 1 122 918        | 0,02              | 910 000 4.800% Canadian Pacific Railway Co 01/08/2045                   | 881 344          | 0,01              |
| 3 500 000 1.250% Canadian Imperial Bank of Commerce 22/06/2026          | 3 130 960        | 0,05              | 7 053 000 3.100% Canadian Pacific Railway Co 02/12/2051                 | 5 065 535        | 0,07              |
| 955 000 3.450% Canadian Imperial Bank of Commerce 07/04/2027            | 906 200          | 0,01              | 7 861 000 6.125% Canadian Pacific Railway Co 15/09/2115                 | 8 451 990        | 0,12              |
| 910 000 3.600% Canadian Imperial Bank of Commerce 07/04/2032            | 828 200          | 0,01              | 2 175 000 2.242% Carrier Global Corp 15/02/2025                         | 2 076 255        | 0,03              |
| 530 000 2.750% Canadian National Railway Co 01/03/2026                  | 507 666          | 0,01              | 4 131 000 2.493% Carrier Global Corp 15/02/2027                         | 3 831 213        | 0,06              |
| 418 000 6.900% Canadian National Railway Co 15/07/2028                  | 466 266          | 0,01              | 3 000 000 2.722% Carrier Global Corp 15/02/2030                         | 2 635 080        | 0,04              |
| 1 775 000 3.850% Canadian National Railway Co 05/08/2032                | 1 686 942        | 0,02              | 1 750 000 2.700% Carrier Global Corp 15/02/2031                         | 1 505 175        | 0,02              |
| 1 050 000 6.250% Canadian National Railway Co 01/08/2034                | 1 182 720        | 0,02              | 168 000 3.377% Carrier Global Corp 05/04/2040                           | 133 419          | 0,00              |
| 537 000 6.375% Canadian National Railway Co 15/11/2037                  | 609 871          | 0,01              | 820 000 3.577% Carrier Global Corp 05/04/2050                           | 620 756          | 0,01              |
| 1 457 000 3.200% Canadian National Railway Co 02/08/2046                | 1 108 515        | 0,02              |   |                  |                   |



## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 50 000 0.450% Caterpillar Financial Services Corp 17/05/2024            | 47 743           | 0,00              | 3 000 000 3.700% Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 15/11/2029        | 2 762 310        | 0,04              |
| 806 000 2.850% Caterpillar Financial Services Corp 17/05/2024           | 790 082          | 0,01              | 400 000 2.742% Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 31/12/2039          | 328 044          | 0,00              |
| 2 000 3.300% Caterpillar Financial Services Corp 09/06/2024             | 1 968            | 0,00              | 370 000 3.150% Church & Dwight Co Inc 01/08/2027                        | 353 853          | 0,01              |
| 2 186 000 2.150% Caterpillar Financial Services Corp 08/11/2024         | 2 108 484        | 0,03              | 1 250 000 5.600% Church & Dwight Co Inc 15/11/2032                      | 1 340 813        | 0,02              |
| 682 000 3.250% Caterpillar Financial Services Corp 01/12/2024           | 667 167          | 0,01              | 270 000 3.950% Church & Dwight Co Inc 01/08/2047                        | 226 179          | 0,00              |
| 2 000 000 4.900% Caterpillar Financial Services Corp 17/01/2025         | 2 014 660        | 0,03              | 275 000 5.000% Church & Dwight Co Inc 15/06/2052                        | 272 148          | 0,00              |
| 4 000 000 5.400% Caterpillar Financial Services Corp 10/03/2025         | 4 076 120        | 0,06              | 8 073 000 3.500% Cisco Systems Inc 15/06/2025                           | 7 910 652        | 0,12              |
| 3 700 000 3.400% Caterpillar Financial Services Corp 13/05/2025         | 3 625 482        | 0,05              | 12 395 000 2.950% Cisco Systems Inc 28/02/2026                          | 12 000 963       | 0,18              |
| 807 000 1.450% Caterpillar Financial Services Corp 15/05/2025           | 758 386          | 0,01              | 22 365 000 2.500% Cisco Systems Inc 20/09/2026                          | 21 123 295       | 0,31              |
| 1 000 000 3.650% Caterpillar Financial Services Corp 12/08/2025         | 982 190          | 0,01              | 32 850 000 5.900% Cisco Systems Inc 15/02/2039                          | 37 077 466       | 0,54              |
| 3 717 000 0.800% Caterpillar Financial Services Corp 13/11/2025         | 3 393 584        | 0,05              | 34 617 000 5.500% Cisco Systems Inc 15/01/2040                          | 37 832 551       | 0,55              |
| 1 000 000 4.800% Caterpillar Financial Services Corp 06/01/2026         | 1 016 240        | 0,01              | 967 000 3.750% Citigroup Inc 16/06/2024                                 | 950 948          | 0,01              |
| 1 500 000 0.900% Caterpillar Financial Services Corp 02/03/2026         | 1 359 990        | 0,02              | 1 775 000 4.000% Citigroup Inc 05/08/2024                               | 1 744 239        | 0,03              |
| 500 000 2.400% Caterpillar Financial Services Corp 09/08/2026           | 469 500          | 0,01              | 1 856 000 3.875% Citigroup Inc 26/03/2025                               | 1 798 427        | 0,03              |
| 450 000 1.700% Caterpillar Financial Services Corp 08/01/2027           | 411 714          | 0,01              | 2 848 000 3.352% Citigroup Inc 24/04/2025                               | 2 777 085        | 0,04              |
| 1 000 000 3.600% Caterpillar Financial Services Corp 12/08/2027         | 978 650          | 0,01              | 1 166 000 3.300% Citigroup Inc 27/04/2025                               | 1 125 283        | 0,02              |
| 356 000 1.100% Caterpillar Financial Services Corp 14/09/2027           | 313 113          | 0,00              | 1 300 000 0.981% Citigroup Inc 01/05/2025                               | 1 236 196        | 0,02              |
| 879 000 3.400% Caterpillar Inc 15/05/2024                               | 869 313          | 0,01              | 645 000 4.140% Citigroup Inc 24/05/2025                                 | 634 158          | 0,01              |
| 37 000 2.600% Caterpillar Inc 19/09/2029                                | 33 787           | 0,00              | 2 674 000 4.400% Citigroup Inc 10/06/2025                               | 2 606 321        | 0,04              |
| 2 462 000 2.600% Caterpillar Inc 09/04/2030                             | 2 206 715        | 0,03              | 2 303 000 5.500% Citigroup Inc 13/09/2025                               | 2 300 950        | 0,03              |
| 10 000 6.050% Caterpillar Inc 15/08/2036                                | 11 301           | 0,00              | 1 516 000 3.700% Citigroup Inc 12/01/2026                               | 1 468 943        | 0,02              |
| 163 000 5.200% Caterpillar Inc 27/05/2041                               | 173 103          | 0,00              | 1 655 000 2.014% Citigroup Inc 25/01/2026                               | 1 558 811        | 0,02              |
| 1 338 000 3.803% Caterpillar Inc 15/08/2042                             | 1 188 679        | 0,02              | 4 196 000 4.600% Citigroup Inc 09/03/2026                               | 4 116 947        | 0,06              |
| 2 850 000 4.300% Caterpillar Inc 15/05/2044                             | 2 727 336        | 0,04              | 2 000 000 3.290% Citigroup Inc 17/03/2026                               | 1 920 660        | 0,03              |
| 1 335 000 3.250% Caterpillar Inc 19/09/2049                             | 1 060 778        | 0,02              | 4 368 000 3.106% Citigroup Inc 08/04/2026                               | 4 176 551        | 0,06              |
| 1 621 000 3.250% Caterpillar Inc 09/04/2050                             | 1 290 316        | 0,02              | 1 597 000 3.400% Citigroup Inc 01/05/2026                               | 1 524 384        | 0,02              |
| 329 000 4.750% Caterpillar Inc 15/05/2064                               | 323 677          | 0,00              | 3 092 000 5.610% Citigroup Inc 29/09/2026                               | 3 110 397        | 0,05              |
| 425 000 1.450% CGI Inc 14/09/2026                                       | 381 650          | 0,01              | 2 144 000 3.200% Citigroup Inc 21/10/2026                               | 2 023 764        | 0,03              |
| 400 000 2.300% CGI Inc 14/09/2031                                       | 317 212          | 0,00              | 1 244 000 4.300% Citigroup Inc 20/11/2026                               | 1 205 312        | 0,02              |
| 2 000 000 5.125% Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 30/06/2027        | 2 002 880        | 0,03              | 3 400 000 1.122% Citigroup Inc 28/01/2027                               | 3 031 544        | 0,04              |
|   |                  |                   | 5 650 000 1.462% Citigroup Inc 09/06/2027                               | 5 020 251        | 0,07              |
|   |                  |                   | 6 966 000 4.450% Citigroup Inc 29/09/2027                               | 6 755 627        | 0,10              |
|   |                  |                   | 3 862 000 3.887% Citigroup Inc 10/01/2028                               | 3 696 899        | 0,05              |
|   |                  |                   | 175 000 6.625% Citigroup Inc 15/01/2028                                 | 188 561          | 0,00              |
|   |                  |                   | 2 225 000 3.070% Citigroup Inc 24/02/2028                               | 2 069 873        | 0,03              |
|   |                  |                   | 1 715 000 4.658% Citigroup Inc 24/05/2028                               | 1 695 655        | 0,02              |
|   |                  |                   | 3 650 000 3.668% Citigroup Inc 24/07/2028                               | 3 457 499        | 0,05              |
|   |                  |                   | 2 982 000 4.125% Citigroup Inc 25/07/2028                               | 2 822 761        | 0,04              |
|   |                  |                   | 3 290 000 3.520% Citigroup Inc 27/10/2028                               | 3 075 464        | 0,05              |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Partici-<br>pation Investissement   | Juste valeur<br>USD | % des<br>actifs<br>nets | Partici-<br>pation Investissement   | Juste valeur<br>USD | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %)<br/>(suite)</b>       |                     |                         | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %)<br/>(suite)</b>       |                     |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %)<br/>(suite)</b> |                     |                         | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %)<br/>(suite)</b> |                     |                         |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                                   |                     |                         | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                                   |                     |                         |
| 2 597 000 4.075% Citigroup Inc 23/04/2029                                   | 2 470 579           | 0,04                    | 719 000 1.650% Coca-Cola Co 01/06/2030                                      | 608 468             | 0,01                    |
| 4 222 000 3.980% Citigroup Inc 20/03/2030                                   | 3 942 799           | 0,06                    | 2 500 000 1.375% Coca-Cola Co 15/03/2031                                    | 2 039 075           | 0,03                    |
| 3 988 000 2.976% Citigroup Inc 05/11/2030                                   | 3 495 163           | 0,05                    | 2 850 000 2.500% Coca-Cola Co 01/06/2040                                    | 2 187 147           | 0,03                    |
| 943 000 2.666% Citigroup Inc 29/01/2031                                     | 805 595             | 0,01                    | 1 000 000 2.875% Coca-Cola Co 05/05/2041                                    | 799 520             | 0,01                    |
| 4 381 000 4.412% Citigroup Inc 31/03/2031                                   | 4 167 689           | 0,06                    | 2 300 000 4.200% Coca-Cola Co 25/03/2050                                    | 2 207 678           | 0,03                    |
| 2 972 000 2.572% Citigroup Inc 03/06/2031                                   | 2 508 368           | 0,04                    | 562 000 2.600% Coca-Cola Co 01/06/2050                                      | 400 773             | 0,01                    |
| 3 835 000 2.561% Citigroup Inc 01/05/2032                                   | 3 177 489           | 0,05                    | 390 000 3.000% Coca-Cola Co 05/03/2051                                      | 302 363             | 0,00                    |
| 2 500 000 6.625% Citigroup Inc 15/06/2032                                   | 2 677 600           | 0,04                    | 1 645 000 2.500% Coca-Cola Co 15/03/2051                                    | 1 155 119           | 0,02                    |
| 1 800 000 2.520% Citigroup Inc 03/11/2032                                   | 1 470 852           | 0,02                    | 3 065 000 2.750% Coca-Cola Co 01/06/2060                                    | 2 174 188           | 0,03                    |
| 1 550 000 3.057% Citigroup Inc 25/01/2033                                   | 1 315 346           | 0,02                    | 6 300 000 3.100% Colgate-Palmolive Co<br>15/08/2025                         | 6 142 815           | 0,09                    |
| 8 000 5.875% Citigroup Inc 22/02/2033                                       | 8 209               | 0,00                    | 8 900 000 3.100% Colgate-Palmolive Co<br>15/08/2027                         | 8 583 516           | 0,13                    |
| 4 000 000 3.785% Citigroup Inc 17/03/2033                                   | 3 586 800           | 0,05                    | 1 070 000 4.600% Colgate-Palmolive Co<br>01/03/2028                         | 1 097 339           | 0,02                    |
| 1 900 000 4.910% Citigroup Inc 24/05/2033                                   | 1 862 152           | 0,03                    | 12 325 000 3.250% Colgate-Palmolive Co<br>15/08/2032                        | 11 555 057          | 0,17                    |
| 1 330 000 6.270% Citigroup Inc 17/11/2033                                   | 1 438 488           | 0,02                    | 1 500 000 4.600% Colgate-Palmolive Co<br>01/03/2033                         | 1 555 995           | 0,02                    |
| 499 000 6.125% Citigroup Inc 25/08/2036                                     | 516 989             | 0,01                    | 2 583 000 4.000% Colgate-Palmolive Co<br>15/08/2045                         | 2 420 865           | 0,04                    |
| 603 000 3.878% Citigroup Inc 24/01/2039                                     | 512 671             | 0,01                    | 2 050 000 3.700% Colgate-Palmolive Co<br>01/08/2047                         | 1 859 555           | 0,03                    |
| 2 342 000 8.125% Citigroup Inc 15/07/2039                                   | 3 029 143           | 0,04                    | 1 600 000 4.500% Columbia Pipeline Group Inc<br>01/06/2025                  | 1 582 496           | 0,02                    |
| 3 505 000 5.316% Citigroup Inc 26/03/2041                                   | 3 478 853           | 0,05                    | 500 000 5.800% Columbia Pipeline Group Inc<br>01/06/2045                    | 506 405             | 0,01                    |
| 3 066 000 5.875% Citigroup Inc 30/01/2042                                   | 3 254 804           | 0,05                    | 300 000 3.375% Comcast Corp 15/08/2025                                      | 293 148             | 0,00                    |
| 873 000 6.675% Citigroup Inc 13/09/2043                                     | 975 953             | 0,01                    | 3 000 000 3.950% Comcast Corp 15/10/2025                                    | 2 965 980           | 0,04                    |
| 3 228 000 5.300% Citigroup Inc 06/05/2044                                   | 3 073 088           | 0,05                    | 5 200 000 3.150% Comcast Corp 01/03/2026                                    | 5 043 948           | 0,07                    |
| 1 550 000 4.650% Citigroup Inc 30/07/2045                                   | 1 411 104           | 0,02                    | 1 950 000 2.350% Comcast Corp 15/01/2027                                    | 1 817 731           | 0,03                    |
| 3 996 000 4.750% Citigroup Inc 18/05/2046                                   | 3 539 737           | 0,05                    | 300 000 3.300% Comcast Corp 01/02/2027                                      | 289 614             | 0,00                    |
| 1 020 000 4.281% Citigroup Inc 24/04/2048                                   | 881 612             | 0,01                    | 50 000 3.300% Comcast Corp 01/04/2027                                       | 48 068              | 0,00                    |
| 2 250 000 4.650% Citigroup Inc 23/07/2048                                   | 2 084 557           | 0,03                    | 4 750 000 3.150% Comcast Corp 15/02/2028                                    | 4 508 890           | 0,07                    |
| 215 000 3.100% Clorox Co 01/10/2027   | 203 657             | 0,00                    | 5 000 000 4.150% Comcast Corp 15/10/2028                                    | 4 946 700           | 0,07                    |
| 2 000 000 4.400% Clorox Co 01/05/2029                                       | 1 977 000           | 0,03                    | 300 000 3.400% Comcast Corp 01/04/2030                                      | 280 482             | 0,00                    |
| 1 802 000 1.800% Clorox Co 15/05/2030                                       | 1 490 831           | 0,02                    | 5 900 000 1.500% Comcast Corp 15/02/2031                                    | 4 731 457           | 0,07                    |
| 2 000 000 4.600% Clorox Co 01/05/2032                                       | 1 986 420           | 0,03                    | 2 200 000 5.500% Comcast Corp 15/11/2032                                    | 2 343 450           | 0,03                    |
| 3 802 000 3.950% CNH Industrial Capital LLC<br>23/05/2025                   | 3 707 647           | 0,05                    | 1 500 000 4.250% Comcast Corp 15/01/2033                                    | 1 461 885           | 0,02                    |
| 6 165 000 5.450% CNH Industrial Capital LLC<br>14/10/2025                   | 6 237 650           | 0,09                    | 1 000 000 4.400% Comcast Corp 15/08/2035                                    | 966 410             | 0,01                    |
| 15 700 000 1.875% CNH Industrial Capital LLC<br>15/01/2026                  | 14 454 990          | 0,21                    | 4 450 000 3.900% Comcast Corp 01/03/2038                                    | 3 996 367           | 0,06                    |
| 8 590 000 1.450% CNH Industrial Capital LLC<br>15/07/2026                   | 7 698 186           | 0,11                    | 3 900 000 4.600% Comcast Corp 15/10/2038                                    | 3 762 447           | 0,06                    |
| 5 708 000 3.850% CNH Industrial NV 15/11/2027                               | 5 486 187           | 0,08                    | 4 800 000 3.250% Comcast Corp 01/11/2039                                    | 3 882 240           | 0,06                    |
| 500 000 1.750% Coca-Cola Co 06/09/2024                                      | 485 185             | 0,01                    | 4 200 000 3.750% Comcast Corp 01/04/2040                                    | 3 609 690           | 0,05                    |
| 958 000 3.375% Coca-Cola Co 25/03/2027                                      | 941 637             | 0,01                    | 3 600 000 4.650% Comcast Corp 15/07/2042                                    | 3 423 348           | 0,05                    |
| 1 819 000 1.450% Coca-Cola Co 01/06/2027                                    | 1 651 652           | 0,02                    | 4 000 000 3.969% Comcast Corp 01/11/2047                                    | 3 375 080           | 0,05                    |
| 2 874 000 1.000% Coca-Cola Co 15/03/2028                                    | 2 492 994           | 0,04                    |   |                     |                         |
| 512 000 2.125% Coca-Cola Co 06/09/2029                                      | 459 720             | 0,01                    |   |                     |                         |
| 2 261 000 3.450% Coca-Cola Co 25/03/2030                                    | 2 170 492           | 0,03                    |   |                     |                         |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets                                     | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|---|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 4 300 000   | 4.000%           | Comcast Corp 01/03/2048                               | 3 640 939   |                  | 0,05              |
| 5 600 000   | 4.700%           | Comcast Corp 15/10/2048                               | 5 306 112   |                  | 0,08              |
| 650 000   | 3.999%           | Comcast Corp 01/11/2049                               | 545 532   |                  | 0,01              |
| 8 000 000   | 2.887%           | Comcast Corp 01/11/2051                               | 5 459 280   |                  | 0,08              |
| 4 400 000   | 2.937%           | Comcast Corp 01/11/2056                               | 2 932 292   |                  | 0,04              |
| 2 500 000   | 2.987%           | Comcast Corp 01/11/2063                               | 1 620 101   |                  | 0,02              |
| 425 000   | 5.079%           | Commonwealth Bank of Australia/New York NY 10/01/2025 | 427 002   |                  | 0,01              |
| 2 018 000   | 2.550%           | Commonwealth Edison Co 15/06/2026                     | 1 900 129   |                  | 0,03              |
| 43 000  | 3.700%           | Commonwealth Edison Co 15/08/2028                     | 41 314  |                  | 0,00              |
| 1 133 000   | 2.200%           | Commonwealth Edison Co 01/03/2030                     | 973 190   |                  | 0,01              |
| 455 000   | 4.900%           | Commonwealth Edison Co 01/02/2033                     | 464 914   |                  | 0,01              |
| 2 000 000   | 5.900%           | Commonwealth Edison Co 15/03/2036                     | 2 148 140   |                  | 0,03              |
| 105 000   | 3.800%           | Commonwealth Edison Co 01/10/2042                     | 88 581  |                  | 0,00              |
| 93 000  | 4.600%           | Commonwealth Edison Co 15/08/2043                     | 86 720  |                  | 0,00              |
| 582 000   | 4.700%           | Commonwealth Edison Co 15/01/2044                     | 548 029   |                  | 0,01              |
| 196 000   | 3.700%           | Commonwealth Edison Co 01/03/2045                     | 157 629   |                  | 0,00              |
| 8 000   | 4.350%           | Commonwealth Edison Co 15/11/2045                     | 7 055   |                  | 0,00              |
| 3 600 000   | 3.650%           | Commonwealth Edison Co 15/06/2046                     | 2 843 208   |                  | 0,04              |
| 900 000   | 3.750%           | Commonwealth Edison Co 15/08/2047                     | 733 473   |                  | 0,01              |
| 432 000   | 4.000%           | Commonwealth Edison Co 01/03/2048                     | 367 550   |                  | 0,01              |
| 1 451 000   | 4.000%           | Commonwealth Edison Co 01/03/2049                     | 1 216 301   |                  | 0,02              |
| 1 000 000   | 3.200%           | Commonwealth Edison Co 15/11/2049                     | 731 350   |                  | 0,01              |
| 145 000   | 3.000%           | Commonwealth Edison Co 01/03/2050                     | 102 589   |                  | 0,00              |
| 3 000 000   | 3.125%           | Commonwealth Edison Co 15/03/2051                     | 2 154 900   |                  | 0,03              |
| 400 000   | 2.750%           | Commonwealth Edison Co 01/09/2051                     | 265 764   |                  | 0,00              |
| 555 000   | 5.300%           | Commonwealth Edison Co 01/02/2053                     | 574 286   |                  | 0,01              |
| 3 254 000   | 4.300%           | Conagra Brands Inc 01/05/2024                         | 3 223 054   |                  | 0,05              |
| 532 000   | 4.600%           | Conagra Brands Inc 01/11/2025                         | 527 042   |                  | 0,01              |
| 324 000   | 1.375%           | Conagra Brands Inc 01/11/2027                         | 277 778   |                  | 0,00              |
| 1 550 000   | 4.850%           | Conagra Brands Inc 01/11/2028                         | 1 545 598   |                  | 0,02              |
| 1 049 000   | 8.250%           | Conagra Brands Inc 15/09/2030                         | 1 227 928   |                  | 0,02              |
| 3 293 000   | 5.300%           | Conagra Brands Inc 01/11/2038                         | 3 231 256   |                  | 0,05              |
| 603 000   | 5.400%           | Conagra Brands Inc 01/11/2048                         | 590 723   |                  | 0,01              |
| 1 425 000   | 0.750%           | Connecticut Light and Power Co 01/12/2025             | 1 287 117   |                  | 0,02              |
| 1 600 000   | 2.050%           | Connecticut Light and Power Co 01/07/2031             | 1 327 216   |                  | 0,02              |
| 1 250 000   | 4.300%           | Connecticut Light and Power Co 15/04/2044             | 1 112 700   |                  | 0,02              |
| 1 621 000   | 4.000%           | Connecticut Light and Power Co 01/04/2048             | 1 395 713   |                  | 0,02              |
| 715 000   | 5.250%           | Connecticut Light and Power Co 15/01/2053             | 738 095   |                  | 0,01              |
| 2 000 000   | 7.250%           | Conoco Funding Co 15/10/2031                          | 2 330 000   |                  | 0,03              |
| 1 850 000   | 6.500%           | ConocoPhillips 01/02/2039                             | 2 160 707   |                  | 0,03              |
| 1 510 000   | 4.875%           | ConocoPhillips 01/10/2047                             | 1 462 435   |                  | 0,02              |
| 170 000   | 3.350%           | ConocoPhillips Co 15/11/2024                          | 166 490   |                  | 0,00              |
| 1 050 000   | 2.400%           | ConocoPhillips Co 07/03/2025                          | 1 007 822   |                  | 0,01              |
| 841 000   | 6.950%           | ConocoPhillips Co 15/04/2029                          | 948 379   |                  | 0,01              |
| 1 727 000   | 4.300%           | ConocoPhillips Co 15/11/2044                          | 1 552 400   |                  | 0,02              |
| 150 000   | 5.950%           | ConocoPhillips Co 15/03/2046                          | 165 681   |                  | 0,00              |
| 2 050 000   | 3.800%           | ConocoPhillips Co 15/03/2052                          | 1 697 502   |                  | 0,02              |
| 1 112 000   | 4.025%           | ConocoPhillips Co 15/03/2062                          | 905 958   |                  | 0,01              |
| 250 000   | 5.600%           | Constellation Energy Generation LLC 01/03/2028        | 257 115   |                  | 0,00              |
| 1 750 000   | 4.750%           | Credit Suisse AG/New York NY 09/08/2024               | 1 690 570   |                  | 0,02              |
| 5 400 000   | 3.625%           | Credit Suisse AG/New York NY 09/09/2024               | 5 160 834   |                  | 0,08              |
| 2 000 000   | 7.950%           | Credit Suisse AG/New York NY 09/01/2025               | 2 003 900   |                  | 0,03              |
| 500 000   | 3.700%           | Credit Suisse AG/New York NY 21/02/2025               | 474 610   |                  | 0,01              |
| 2 000 000   | 2.950%           | Credit Suisse AG/New York NY 09/04/2025               | 1 858 300   |                  | 0,03              |
| 1 500 000   | 1.250%           | Credit Suisse AG/New York NY 07/08/2026               | 1 269 960   |                  | 0,02              |
| 1 000 000   | 5.000%           | Credit Suisse AG/New York NY 09/07/2027               | 962 100   |                  | 0,01              |
| 2 000 000   | 7.500%           | Credit Suisse AG/New York NY 15/02/2028               | 2 121 560   |                  | 0,03              |
| 4 232 000   | 3.750%           | Credit Suisse Group AG 26/03/2025                     | 3 899 153   |                  | 0,06              |
| 2 000 000   | 4.550%           | Credit Suisse Group AG 17/04/2026                     | 1 837 660   |                  | 0,03              |
| 2 700 000   | 4.875%           | Credit Suisse Group AG 15/05/2045                     | 2 311 794   |                  | 0,03              |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets                            | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|--|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |  | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |  | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |  | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 1 150 000   | 7.125%           | Credit Suisse USA Inc 15/07/2032             | 1 275 304   | 0,02             |                   |
| 2 000   | 0.750%           | Cummins Inc 01/09/2025                       | 1 828   | 0,00             |                   |
| 2 837 000   | 1.500%           | Cummins Inc 01/09/2030                       | 2 321 943   | 0,03             |                   |
| 1 000 000   | 4.875%           | Cummins Inc 01/10/2043                       | 968 180   | 0,01             |                   |
| 621 000   | 2.600%           | Cummins Inc 01/09/2050                       | 405 941   | 0,01             |                   |
| 50 000  | 3.375%           | CVS Health Corp 12/08/2024                   | 49 020  | 0,00             |                   |
| 500 000   | 2.625%           | CVS Health Corp 15/08/2024                   | 485 515   | 0,01             |                   |
| 1 000 000   | 4.100%           | CVS Health Corp 25/03/2025                   | 993 080   | 0,01             |                   |
| 3 600 000   | 3.875%           | CVS Health Corp 20/07/2025                   | 3 535 416   | 0,05             |                   |
| 680 000   | 5.000%           | CVS Health Corp 20/02/2026                   | 687 854   | 0,01             |                   |
| 3 050 000   | 2.875%           | CVS Health Corp 01/06/2026                   | 2 898 201   | 0,04             |                   |
| 1 000 000   | 3.000%           | CVS Health Corp 15/08/2026                   | 954 160   | 0,01             |                   |
| 1 000 000   | 3.625%           | CVS Health Corp 01/04/2027                   | 963 770   | 0,01             |                   |
| 2 800 000   | 1.300%           | CVS Health Corp 21/08/2027                   | 2 436 280   | 0,04             |                   |
| 4 000 000   | 4.300%           | CVS Health Corp 25/03/2028                   | 3 928 760   | 0,06             |                   |
| 500 000   | 3.250%           | CVS Health Corp 15/08/2029                   | 457 330   | 0,01             |                   |
| 3 000 000   | 5.125%           | CVS Health Corp 21/02/2030                   | 3 035 710   | 0,04             |                   |
| 3 000 000   | 3.750%           | CVS Health Corp 01/04/2030                   | 2 806 170   | 0,04             |                   |
| 2 000 000   | 1.750%           | CVS Health Corp 21/08/2030                   | 1 625 740   | 0,02             |                   |
| 2 000 000   | 1.875%           | CVS Health Corp 28/02/2031                   | 1 620 140   | 0,02             |                   |
| 2 500 000   | 2.125%           | CVS Health Corp 15/09/2031                   | 2 040 625   | 0,03             |                   |
| 1 200 000   | 5.250%           | CVS Health Corp 21/02/2033                   | 1 222 260   | 0,02             |                   |
| 800 000   | 4.875%           | CVS Health Corp 20/07/2035                   | 782 936   | 0,01             |                   |
| 4 175 000   | 4.780%           | CVS Health Corp 25/03/2038                   | 3 977 940   | 0,06             |                   |
| 1 000 000   | 4.125%           | CVS Health Corp 01/04/2040                   | 860 150   | 0,01             |                   |
| 50 000  | 2.700%           | CVS Health Corp 21/08/2040                   | 35 784  | 0,00             |                   |
| 5 000 000   | 5.125%           | CVS Health Corp 20/07/2045                   | 4 738 750   | 0,07             |                   |
| 8 800 000   | 5.050%           | CVS Health Corp 25/03/2048                   | 8 234 424   | 0,12             |                   |
| 2 000 000   | 4.250%           | CVS Health Corp 01/04/2050                   | 1 664 800   | 0,02             |                   |
| 1 000 000   | 5.625%           | CVS Health Corp 21/02/2053                   | 1 012 940   | 0,01             |                   |
| 550 000   | 3.350%           | Danaher Corp 15/09/2025                      | 538 351   | 0,01             |                   |
| 200 000   | 4.375%           | Danaher Corp 15/09/2045                      | 186 054   | 0,00             |                   |
| 1 300 000   | 2.600%           | Danaher Corp 01/10/2050                      | 889 538   | 0,01             |                   |
| 15 000  | 3.950%           | Dayton Power & Light Co 15/06/2049           | 11 948  | 0,00             |                   |
| 1 000 000   | 5.375%           | Deere & Co 16/10/2029                        | 1 062 040   | 0,02             |                   |
| 800 000   | 7.125%           | Deere & Co 03/03/2031                        | 945 808   | 0,01             |                   |
| 680 000   | 3.900%           | Deere & Co 09/06/2042                        | 624 995   | 0,01             |                   |
| 1 500 000   | 3.750%           | Deere & Co 15/04/2050                        | 1 330 605   | 0,02             |                   |
| 300 000   | 6.500%           | Dell Inc 15/04/2038                          | 303 348   | 0,00             |                   |
| 946 000   | 4.000%           | Dell International LLC / EMC Corp 15/07/2024 | 932 415   | 0,01             |                   |
| 570 000   | 5.850%           | Dell International LLC / EMC Corp 15/07/2025 | 579 399   | 0,01             |                   |
| 7 115 000   | 6.020%           | Dell International LLC / EMC Corp 15/06/2026 | 7 302 623   | 0,11             |                   |
| 3 310 000   | 4.900%           | Dell International LLC / EMC Corp 01/10/2026 | 3 291 894   | 0,05             |                   |
| 1 390 000   | 6.100%           | Dell International LLC / EMC Corp 15/07/2027 | 1 460 000   | 0,02             |                   |
| 500 000   | 5.250%           | Dell International LLC / EMC Corp 01/02/2028 | 504 765   | 0,01             |                   |
| 2 117 000   | 5.300%           | Dell International LLC / EMC Corp 01/10/2029 | 2 130 337   | 0,03             |                   |
| 1 849 000   | 6.200%           | Dell International LLC / EMC Corp 15/07/2030 | 1 944 297   | 0,03             |                   |
| 310 000   | 5.750%           | Dell International LLC / EMC Corp 01/02/2033 | 309 802   | 0,00             |                   |
| 1 253 000   | 8.100%           | Dell International LLC / EMC Corp 15/07/2036 | 1 456 625   | 0,02             |                   |
| 1 076 000   | 8.350%           | Dell International LLC / EMC Corp 15/07/2046 | 1 309 072   | 0,02             |                   |
| 910 000   | 3.450%           | Dell International LLC / EMC Corp 15/12/2051 | 592 692   | 0,01             |                   |
| 1 770 000   | 4.150%           | Delmarva Power & Light Co 15/05/2045         | 1 502 234   | 0,02             |                   |
| 2 000 000   | 4.500%           | Deutsche Bank AG 01/04/2025                  | 1 836 220   | 0,03             |                   |
| 2 390 000   | 4.100%           | Deutsche Bank AG 13/01/2026                  | 2 184 890   | 0,03             |                   |
| 835 000   | 3.700%           | Deutsche Bank AG/London 30/05/2024           | 795 989   | 0,01             |                   |
| 184 000   | 3.700%           | Deutsche Bank AG/New York 30/05/2024         | 174 752   | 0,00             |                   |
| 90 000  | 1.447%           | Deutsche Bank AG/New York NY 01/04/2025      | 83 802  | 0,00             |                   |
| 2 480 000   | 4.162%           | Deutsche Bank AG/New York NY 13/05/2025      | 2 371 351   | 0,03             |                   |
| 4 381 000   | 3.961%           | Deutsche Bank AG/New York NY 26/11/2025      | 4 141 797   | 0,06             |                   |
| 350 000   | 4.100%           | Deutsche Bank AG/New York NY 13/01/2026      | 318 773   | 0,00             |                   |
| 900 000   | 1.686%           | Deutsche Bank AG/New York NY 19/03/2026      | 797 544   | 0,01             |                   |
| 2 735 000   | 6.119%           | Deutsche Bank AG/New York NY 14/07/2026      | 2 654 017   | 0,04             |                   |
| 1 427 000   | 2.129%           | Deutsche Bank AG/New York NY 24/11/2026      | 1 227 919   | 0,02             |                   |
| 1 753 000   | 5.371%           | Deutsche Bank AG/New York NY 09/09/2027      | 1 727 827   | 0,03             |                   |
| 2 075 000   | 2.311%           | Deutsche Bank AG/New York NY 16/11/2027      | 1 755 927   | 0,03             |                   |
| 2 400 000   | 2.552%           | Deutsche Bank AG/New York NY 07/01/2028      | 2 044 368   | 0,03             |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 485 000 6.720% Deutsche Bank AG/New York NY 18/01/2029                  | 482 905          | 0,01              | 960 000 3.700% Digital Realty Trust LP 15/08/2027                       | 886 723          | 0,01              |
| 500 000 5.882% Deutsche Bank AG/New York NY 08/07/2031                  | 434 850          | 0,01              | 2 900 000 5.550% Digital Realty Trust LP 15/01/2028                     | 2 897 071        | 0,04              |
| 1 388 000 3.547% Deutsche Bank AG/New York NY 18/09/2031                | 1 138 563        | 0,02              | 355 000 4.450% Digital Realty Trust LP 15/07/2028                       | 334 165          | 0,00              |
| 500 000 3.729% Deutsche Bank AG/New York NY 14/01/2032                  | 373 490          | 0,01              | 1 715 000 3.600% Digital Realty Trust LP 01/07/2029                     | 1 535 834        | 0,02              |
| 1 000 000 4.875% Deutsche Bank AG/New York NY 01/12/2032                | 814 330          | 0,01              | 4 143 000 3.071% Dominion Energy Inc 15/08/2024                         | 4 026 996        | 0,06              |
| 1 700 000 3.742% Deutsche Bank AG/New York NY 07/01/2033                | 1 234 965        | 0,02              | 1 000 000 3.300% Dominion Energy Inc 15/03/2025                         | 965 110          | 0,01              |
| 1 100 000 7.079% Deutsche Bank AG/New York NY 10/02/2034                | 1 018 864        | 0,02              | 168 000 3.900% Dominion Energy Inc 01/10/2025                           | 164 153          | 0,00              |
| 44 105 000 8.750% Deutsche Telekom International Finance BV 15/06/2030  | 53 896 751       | 0,79              | 500 000 1.450% Dominion Energy Inc 15/04/2026                           | 452 095          | 0,01              |
| 8 750 000 9.250% Deutsche Telekom International Finance BV 01/06/2032   | 11 381 300       | 0,17              | 1 185 000 2.850% Dominion Energy Inc 15/08/2026                         | 1 112 063        | 0,02              |
| 200 000 5.250% Devon Energy Corp 15/09/2024                             | 200 402          | 0,00              | 4 394 000 4.250% Dominion Energy Inc 01/06/2028                         | 4 275 845        | 0,06              |
| 1 000 000 5.250% Devon Energy Corp 15/10/2027                           | 1 000 380        | 0,01              | 13 980 000 3.375% Dominion Energy Inc 01/04/2030                        | 12 644 243       | 0,19              |
| 200 000 5.875% Devon Energy Corp 15/06/2028                             | 203 108          | 0,00              | 2 000 000 2.250% Dominion Energy Inc 15/08/2031                         | 1 647 220        | 0,02              |
| 200 000 4.500% Devon Energy Corp 15/01/2030                             | 191 020          | 0,00              | 1 000 000 4.350% Dominion Energy Inc 15/08/2032                         | 956 590          | 0,01              |
| 13 000 7.875% Devon Energy Corp 30/09/2031                              | 14 930           | 0,00              | 11 700 000 5.375% Dominion Energy Inc 15/11/2032                        | 11 975 459       | 0,18              |
| 689 000 7.950% Devon Energy Corp 15/04/2032                             | 802 768          | 0,01              | 1 702 000 6.300% Dominion Energy Inc 15/03/2033                         | 1 870 821        | 0,03              |
| 3 170 000 5.600% Devon Energy Corp 15/07/2041                           | 3 036 733        | 0,04              | 483 000 5.250% Dominion Energy Inc 01/08/2033                           | 486 869          | 0,01              |
| 655 000 5.000% Devon Energy Corp 15/06/2045                             | 582 708          | 0,01              | 500 000 5.950% Dominion Energy Inc 15/06/2035                           | 528 940          | 0,01              |
| 1 000 000 2.200% DH Europe Finance II Sarl 15/11/2024                   | 960 080          | 0,01              | 2 502 000 7.000% Dominion Energy Inc 15/06/2038                         | 2 845 149        | 0,04              |
| 130 000 2.600% DH Europe Finance II Sarl 15/11/2029                     | 116 305          | 0,00              | 200 000 3.300% Dominion Energy Inc 15/04/2041                           | 153 986          | 0,00              |
| 2 700 000 3.400% DH Europe Finance II Sarl 15/11/2049                   | 2 131 596        | 0,03              | 1 613 000 4.900% Dominion Energy Inc 01/08/2041                         | 1 478 702        | 0,02              |
| 17 380 000 2.125% Diageo Capital PLC 24/10/2024                         | 16 691 404       | 0,24              | 3 157 000 4.050% Dominion Energy Inc 15/09/2042                         | 2 539 838        | 0,04              |
| 15 264 000 1.375% Diageo Capital PLC 29/09/2025                         | 14 104 089       | 0,21              | 2 000 000 4.700% Dominion Energy Inc 01/12/2044                         | 1 784 440        | 0,03              |
| 4 705 000 5.200% Diageo Capital PLC 24/10/2025                          | 4 769 741        | 0,07              | 250 000 4.600% Dominion Energy Inc 15/03/2049                           | 218 698          | 0,00              |
| 8 950 000 5.300% Diageo Capital PLC 24/10/2027                          | 9 306 478        | 0,14              | 7 200 000 4.850% Dominion Energy Inc 15/08/2052                         | 6 509 312        | 0,10              |
| 5 100 000 3.875% Diageo Capital PLC 18/05/2028                          | 4 985 046        | 0,07              | 1 100 000 5.750% Dominion Energy Inc 01/10/2054                         | 1 034 352        | 0,02              |
| 13 205 000 2.375% Diageo Capital PLC 24/10/2029                         | 11 630 832       | 0,17              |   |                  |                   |
| 22 770 000 2.000% Diageo Capital PLC 29/04/2030                         | 19 401 178       | 0,28              |   |                  |                   |
| 17 800 000 2.125% Diageo Capital PLC 29/04/2032                         | 14 778 984       | 0,22              |   |                  |                   |
| 12 321 000 5.500% Diageo Capital PLC 24/01/2033                         | 13 353 869       | 0,20              |   |                  |                   |
| 11 145 000 5.875% Diageo Capital PLC 30/09/2036                         | 12 218 709       | 0,18              |   |                  |                   |
| 8 000 000 3.875% Diageo Capital PLC 29/04/2043                          | 6 963 840        | 0,10              |   |                  |                   |
| 2 200 000 7.450% Diageo Investment Corp 15/04/2035                      | 2 725 030        | 0,04              |   |                  |                   |
| 6 130 000 4.250% Diageo Investment Corp 11/05/2042                      | 5 817 309        | 0,09              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 5 000 6.625% Dominion Energy South Carolina Inc 01/02/2032              | 5 643            | 0,00              |
| 1 800 000 5.300% Dominion Energy South Carolina Inc 15/05/2033          | 1 882 890        | 0,03              |
| 1 010 000 6.050% Dominion Energy South Carolina Inc 15/06/2038          | 1 113 121        | 0,02              |
| 372 000 5.450% Dominion Energy South Carolina Inc 01/02/2041            | 379 295          | 0,01              |
| 2 200 000 5.100% Dominion Energy South Carolina Inc 01/06/2065          | 2 201 386        | 0,03              |
| 200 000 7.375% Dow Chemical Co 01/11/2029                               | 228 296          | 0,00              |
| 965 000 6.300% Dow Chemical Co 15/03/2033                               | 1 049 949        | 0,02              |
| 1 000 000 5.250% Dow Chemical Co 15/11/2041                             | 971 040          | 0,01              |
| 3 300 000 4.375% Dow Chemical Co 15/11/2042                             | 2 860 110        | 0,04              |
| 500 000 4.625% Dow Chemical Co 01/10/2044                               | 446 690          | 0,01              |
| 500 000 5.550% Dow Chemical Co 30/11/2048                               | 492 510          | 0,01              |
| 1 000 000 4.800% Dow Chemical Co 15/05/2049                             | 886 890          | 0,01              |
| 1 500 000 3.600% Dow Chemical Co 15/11/2050                             | 1 121 805        | 0,02              |
| 3 500 000 6.900% Dow Chemical Co 15/05/2053                             | 4 039 400        | 0,06              |
| 1 955 000 3.375% DTE Electric Co 01/03/2025                             | 1 904 053        | 0,03              |
| 118 000 2.625% DTE Electric Co 01/03/2031                               | 102 085          | 0,00              |
| 2 000 000 5.200% DTE Electric Co 01/04/2033                             | 2 065 560        | 0,03              |
| 10 000 4.000% DTE Electric Co 01/04/2043                                | 8 606            | 0,00              |
| 590 000 4.300% DTE Electric Co 01/07/2044                               | 523 513          | 0,01              |
| 1 268 000 3.700% DTE Electric Co 15/03/2045                             | 1 032 431        | 0,02              |
| 910 000 3.750% DTE Electric Co 15/08/2047                               | 739 330          | 0,01              |
| 500 000 4.050% DTE Electric Co 15/05/2048                               | 428 450          | 0,01              |
| 509 000 3.950% DTE Electric Co 01/03/2049                               | 428 222          | 0,01              |
| 584 000 2.950% DTE Electric Co 01/03/2050                               | 410 494          | 0,01              |
| 2 323 000 2.529% DTE Energy Co 01/10/2024                               | 2 235 446        | 0,03              |
| 1 050 000 4.220% DTE Energy Co 01/11/2024                               | 1 039 133        | 0,02              |
| 3 642 000 1.050% DTE Energy Co 01/06/2025                               | 3 345 250        | 0,05              |
| 5 000 2.850% DTE Energy Co 01/10/2026                                   | 4 683            | 0,00              |
| 1 136 000 3.400% DTE Energy Co 15/06/2029                               | 1 040 156        | 0,02              |
| 500 000 2.950% DTE Energy Co 01/03/2030                                 | 438 865          | 0,01              |
| 1 943 000 2.650% Duke Energy Corp 01/09/2026                            | 1 819 911        | 0,03              |
| 2 000 000 5.400% Duke Energy Indiana LLC 01/04/2053                     | 2 045 880        | 0,03              |
| 800 000 5.650% Duke Energy Ohio Inc 01/04/2053                          | 858 306          | 0,01              |
| 710 000 1.800% DXC Technology Co 15/09/2026                             | 620 945          | 0,01              |
| 150 000 2.375% DXC Technology Co 15/09/2028                             | 127 265          | 0,00              |
| 1 000 000 3.103% Eaton Corp 15/09/2027                                  | 947 080          | 0,01              |
| 135 000 4.000% Eaton Corp 02/11/2032                                    | 128 625          | 0,00              |
| 1 930 000 4.150% Eaton Corp 15/03/2033                                  | 1 860 018        | 0,03              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 830 000 4.150% Eaton Corp 02/11/2042                                    | 733 280          | 0,01              |
| 1 330 000 4.700% Eaton Corp 23/08/2052                                  | 1 279 407        | 0,02              |
| 1 867 000 3.450% eBay Inc 01/08/2024                                    | 1 829 268        | 0,03              |
| 2 095 000 4.828% eBay Inc 11/03/2025                                    | 1 981 640        | 0,03              |
| 700 000 5.900% eBay Inc 22/11/2025                                      | 718 914          | 0,01              |
| 4 500 000 1.400% eBay Inc 10/05/2026                                    | 4 083 885        | 0,06              |
| 1 380 000 3.600% eBay Inc 05/06/2027                                    | 1 320 315        | 0,02              |
| 1 000 000 5.950% eBay Inc 22/11/2027                                    | 1 044 150        | 0,02              |
| 1 081 000 2.700% eBay Inc 11/03/2030                                    | 946 740          | 0,01              |
| 1 500 000 2.600% eBay Inc 10/05/2031                                    | 1 277 955        | 0,02              |
| 1 000 000 6.300% eBay Inc 22/11/2032                                    | 1 085 950        | 0,02              |
| 6 315 000 4.000% eBay Inc 15/07/2042                                    | 5 197 056        | 0,08              |
| 16 980 000 3.650% eBay Inc 10/05/2051                                   | 12 700 870       | 0,19              |
| 559 000 2.700% Ecolab Inc 01/11/2026                                    | 530 295          | 0,01              |
| 751 000 3.250% Ecolab Inc 01/12/2027                                    | 718 136          | 0,01              |
| 2 000 000 5.250% Ecolab Inc 15/01/2028                                  | 2 075 020        | 0,03              |
| 909 000 4.800% Ecolab Inc 24/03/2030                                    | 927 271          | 0,01              |
| 1 516 000 1.300% Ecolab Inc 30/01/2031                                  | 1 202 688        | 0,02              |
| 2 000 000 2.125% Ecolab Inc 01/02/2032                                  | 1 670 820        | 0,02              |
| 209 000 5.500% Ecolab Inc 08/12/2041                                    | 220 008          | 0,00              |
| 299 000 2.125% Ecolab Inc 15/08/2050                                    | 180 109          | 0,00              |
| 800 000 2.700% Ecolab Inc 15/12/2051                                    | 531 360          | 0,01              |
| 590 000 2.750% Ecolab Inc 18/08/2055                                    | 377 936          | 0,01              |
| 1 900 000 4.300% Edwards Lifesciences Corp 15/06/2028                   | 1 892 267        | 0,03              |
| 50 000 7.500% Enbridge Energy Partners LP 15/04/2038                    | 58 295           | 0,00              |
| 1 000 000 5.500% Enbridge Energy Partners LP 15/09/2040                 | 967 510          | 0,01              |
| 1 500 000 3.500% Enbridge Inc 10/06/2024                                | 1 468 365        | 0,02              |
| 3 100 000 2.500% Enbridge Inc 15/01/2025                                | 2 974 760        | 0,04              |
| 1 530 000 4.250% Enbridge Inc 01/12/2026                                | 1 502 858        | 0,02              |
| 50 000 3.125% Enbridge Inc 15/11/2029                                   | 45 079           | 0,00              |
| 1 110 000 5.700% Enbridge Inc 08/03/2033                                | 1 155 621        | 0,02              |
| 2 000 000 5.500% Enbridge Inc 01/12/2046                                | 1 941 260        | 0,03              |
| 8 924 000 4.000% Enel Americas SA 25/10/2026                            | 8 589 885        | 0,13              |
| 14 890 000 4.875% Enel Chile SA 12/06/2028                              | 14 437 195       | 0,21              |
| 3 679 000 4.250% Enel Generacion Chile SA 15/04/2024                    | 3 636 471        | 0,05              |
| 794 000 7.300% Eni USA Inc 15/11/2027                                   | 871 828          | 0,01              |
| 950 000 3.100% Equifax Inc 15/05/2030                                   | 827 488          | 0,01              |
| 889 000 3.375% ERP Operating LP 01/06/2025                              | 859 414          | 0,01              |
| 10 000 2.850% ERP Operating LP 01/11/2026                               | 9 342            | 0,00              |
| 200 000 3.250% ERP Operating LP 01/08/2027                              | 187 878          | 0,00              |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets                                     | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|---|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 2 134 000   | 3.000%           | ERP Operating LP 01/07/2029                           | 1 899 388   | 0,03             |                   |
| 1 359 000   | 2.500%           | ERP Operating LP 15/02/2030                           | 1 167 286   | 0,02             |                   |
| 50 000  | 1.850%           | ERP Operating LP 01/08/2031                           | 40 025  | 0,00             |                   |
| 1 896 000   | 4.500%           | ERP Operating LP 01/07/2044                           | 1 657 976   | 0,02             |                   |
| 370 000   | 4.500%           | ERP Operating LP 01/06/2045                           | 318 237   | 0,00             |                   |
| 1 753 000   | 4.000%           | ERP Operating LP 01/08/2047                           | 1 404 924   | 0,02             |                   |
| 500 000   | 2.000%           | Estee Lauder Cos Inc 01/12/2024                       | 481 590   | 0,01             |                   |
| 100 000   | 2.375%           | Estee Lauder Cos Inc 01/12/2029                       | 88 459  | 0,00             |                   |
| 640 000   | 1.950%           | Estee Lauder Cos Inc 15/03/2031                       | 537 952   | 0,01             |                   |
| 1 000 000   | 4.375%           | Estee Lauder Cos Inc 15/06/2045                       | 934 970   | 0,01             |                   |
| 440 000   | 4.150%           | Estee Lauder Cos Inc 15/03/2047                       | 402 424   | 0,01             |                   |
| 1 000 000   | 3.125%           | Estee Lauder Cos Inc 01/12/2049                       | 768 700   | 0,01             |                   |
| 1 110 000   | 4.200%           | Eversource Energy 27/06/2024                          | 1 098 068   | 0,02             |                   |
| 1 431 000   | 2.900%           | Eversource Energy 01/10/2024                          | 1 382 389   | 0,02             |                   |
| 598 000   | 3.150%           | Eversource Energy 15/01/2025                          | 580 132   | 0,01             |                   |
| 350 000   | 2.900%           | Eversource Energy 01/03/2027                          | 326 687   | 0,00             |                   |
| 1 400 000   | 4.600%           | Eversource Energy 01/07/2027                          | 1 401 596   | 0,02             |                   |
| 765 000   | 3.300%           | Eversource Energy 15/01/2028                          | 718 786   | 0,01             |                   |
| 910 000   | 5.450%           | Eversource Energy 01/03/2028                          | 943 779   | 0,01             |                   |
| 1 000 000   | 4.250%           | Eversource Energy 01/04/2029                          | 978 690   | 0,01             |                   |
| 1 563 000   | 1.650%           | Eversource Energy 15/08/2030                          | 1 258 324   | 0,02             |                   |
| 400 000   | 2.550%           | Eversource Energy 15/03/2031                          | 340 968   | 0,01             |                   |
| 20 000  | 3.450%           | Eversource Energy 15/01/2050                          | 15 271  | 0,00             |                   |
| 2 322 000   | 3.950%           | Exelon Corp 15/06/2025                                | 2 272 983   | 0,03             |                   |
| 2 504 000   | 3.400%           | Exelon Corp 15/04/2026                                | 2 407 997   | 0,04             |                   |
| 950 000   | 5.150%           | Exelon Corp 15/03/2028                                | 967 680   | 0,01             |                   |
| 3 607 000   | 4.050%           | Exelon Corp 15/04/2030                                | 3 439 058   | 0,05             |                   |
| 1 400 000   | 5.300%           | Exelon Corp 15/03/2033                                | 1 425 438   | 0,02             |                   |
| 1 730 000   | 4.950%           | Exelon Corp 15/06/2035                                | 1 709 015   | 0,03             |                   |
| 271 000   | 5.625%           | Exelon Corp 15/06/2035                                | 283 011   | 0,00             |                   |
| 5 219 000   | 5.100%           | Exelon Corp 15/06/2045                                | 4 940 149   | 0,07             |                   |
| 2 349 000   | 4.450%           | Exelon Corp 15/04/2046                                | 2 027 469   | 0,03             |                   |
| 7 000 000   | 4.700%           | Exelon Corp 15/04/2050                                | 6 348 230   | 0,09             |                   |
| 1 000 000   | 4.100%           | Exelon Corp 15/03/2052                                | 825 360   | 0,01             |                   |
| 1 350 000   | 5.600%           | Exelon Corp 15/03/2053                                | 1 376 541   | 0,02             |                   |
| 2 000 000   | 1.150%           | Fidelity National Information Services Inc 01/03/2026 | 1 786 100   | 0,03             |                   |
| 1 000 000   | 3.100%           | Fidelity National Information Services Inc 01/03/2041 | 699 250   | 0,01             |                   |
| 2 000 000   | 5.625%           | Fidelity National Information Services Inc 15/07/2052 | 1 918 700   | 0,03             |                   |
| 570 000   | 5.450%           | Fiserv Inc 02/03/2028                                 | 582 227   | 0,01             |                   |
| 4 000   | 4.750%           | Flex Ltd 15/06/2025                                   | 3 934   | 0,00             |                   |
| 1 128 000   | 3.750%           | Flex Ltd 01/02/2026                                   | 1 083 320   | 0,02             |                   |
| 1 400 000   | 6.000%           | Flex Ltd 15/01/2028                                   | 1 427 580   | 0,02             |                   |
| 1 800 000   | 4.875%           | Flex Ltd 15/06/2029                                   | 1 742 256   | 0,03             |                   |
| 1 081 000   | 4.875%           | Flex Ltd 12/05/2030                                   | 1 051 402   | 0,02             |                   |
| 1 270 000   | 5.100%           | Florida Power & Light Co 01/04/2033                   | 1 319 314   | 0,02             |                   |
| 200 000   | 5.300%           | Florida Power & Light Co 01/04/2053                   | 212 972   | 0,00             |                   |
| 50 000  | 4.550%           | Freeport-McMoRan Inc 14/11/2024                       | 49 711  | 0,00             |                   |
| 700 000   | 5.000%           | Freeport-McMoRan Inc 01/09/2027                       | 689 157   | 0,01             |                   |
| 500 000   | 4.125%           | Freeport-McMoRan Inc 01/03/2028                       | 470 620   | 0,01             |                   |
| 3 350 000   | 4.375%           | Freeport-McMoRan Inc 01/08/2028                       | 3 162 534   | 0,05             |                   |
| 1 000 000   | 5.250%           | Freeport-McMoRan Inc 01/09/2029                       | 986 890   | 0,01             |                   |
| 2 000 000   | 4.625%           | Freeport-McMoRan Inc 01/08/2030                       | 1 897 720   | 0,03             |                   |
| 1 700 000   | 5.450%           | Freeport-McMoRan Inc 15/03/2043                       | 1 590 962   | 0,02             |                   |
| 921 000   | 4.000%           | General Mills Inc 17/04/2025                          | 908 834   | 0,01             |                   |
| 945 000   | 5.241%           | General Mills Inc 18/11/2025                          | 947 457   | 0,01             |                   |
| 1 499 000   | 3.200%           | General Mills Inc 10/02/2027                          | 1 441 498   | 0,02             |                   |
| 274 000   | 4.200%           | General Mills Inc 17/04/2028                          | 271 181   | 0,00             |                   |
| 6 662 000   | 2.875%           | General Mills Inc 15/04/2030                          | 5 979 878   | 0,09             |                   |
| 1 310 000   | 2.250%           | General Mills Inc 14/10/2031                          | 1 090 863   | 0,02             |                   |
| 715 000   | 4.950%           | General Mills Inc 29/03/2033                          | 726 333   | 0,01             |                   |
| 2 313 000   | 5.400%           | General Mills Inc 15/06/2040                          | 2 385 318   | 0,03             |                   |
| 5 000 000   | 4.150%           | General Mills Inc 15/02/2043                          | 4 482 950   | 0,07             |                   |
| 3 524 000   | 3.000%           | General Mills Inc 01/02/2051                          | 2 573 542   | 0,04             |                   |
| 2 249 000   | 4.000%           | General Motors Co 01/04/2025                          | 2 190 706   | 0,03             |                   |
| 3 528 000   | 6.125%           | General Motors Co 01/10/2025                          | 3 589 669   | 0,05             |                   |
| 1 971 000   | 4.200%           | General Motors Co 01/10/2027                          | 1 889 874   | 0,03             |                   |
| 662 000   | 6.800%           | General Motors Co 01/10/2027                          | 700 111   | 0,01             |                   |
| 563 000   | 5.000%           | General Motors Co 01/10/2028                          | 554 634   | 0,01             |                   |
| 1 500 000   | 5.400%           | General Motors Co 15/10/2029                          | 1 487 790   | 0,02             |                   |
| 1 500 000   | 5.600%           | General Motors Co 15/10/2032                          | 1 465 125   | 0,02             |                   |
| 1 152 000   | 5.000%           | General Motors Co 01/04/2035                          | 1 057 432   | 0,02             |                   |
| 3 348 000   | 6.600%           | General Motors Co 01/04/2036                          | 3 450 683   | 0,05             |                   |
| 1 973 000   | 5.150%           | General Motors Co 01/04/2038                          | 1 782 605   | 0,03             |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD                           | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD                           | % des actifs nets |
|---|--|-------------------|---|--|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |  |                   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |  |                   |
| 3 833 000 6.250%  | General Motors Co 02/10/2043               | 3 686 733 0,05    | 2 000 000 6.400%  | General Motors Financial Co Inc 09/01/2033 | 2 060 280 0,03    |
| 2 242 000 5.200%  | General Motors Co 01/04/2045               | 1 880 791 0,03    | 2 904 000 3.625%  | GlaxoSmithKline Capital Inc 15/05/2025     | 2 869 007 0,04    |
| 690 000 6.750%  | General Motors Co 01/04/2046               | 699 508 0,01      | 4 007 000 3.875%  | GlaxoSmithKline Capital Inc 15/05/2028     | 3 931 555 0,06    |
| 577 000 5.400%  | General Motors Co 01/04/2048               | 498 597 0,01      | 1 000 000 5.375%  | GlaxoSmithKline Capital Inc 15/04/2034     | 1 066 930 0,02    |
| 10 511 000 5.950%   | General Motors Co 01/04/2049               | 9 854 798 0,14    | 5 902 000 6.375%  | GlaxoSmithKline Capital Inc 15/05/2038     | 6 951 140 0,10    |
| 1 028 000 3.950%  | General Motors Financial Co Inc 13/04/2024 | 1 010 606 0,01    | 4 200 000 4.200%  | GlaxoSmithKline Capital Inc 18/03/2043     | 3 807 558 0,06    |
| 1 164 000 3.500%  | General Motors Financial Co Inc 07/11/2024 | 1 133 771 0,02    | 3 926 000 3.000%  | GlaxoSmithKline Capital PLC 01/06/2024     | 3 847 794 0,06    |
| 1 152 000 4.000%  | General Motors Financial Co Inc 15/01/2025 | 1 123 177 0,02    | 4 221 000 3.375%  | GlaxoSmithKline Capital PLC 01/06/2029     | 4 009 950 0,06    |
| 1 460 000 2.900%  | General Motors Financial Co Inc 26/02/2025 | 1 395 629 0,02    | 425 000 3.750%  | Goldman Sachs BDC Inc 10/02/2025           | 405 769 0,01      |
| 550 000 3.800%  | General Motors Financial Co Inc 07/04/2025 | 534 490 0,01      | 728 000 6.345%  | Goldman Sachs Capital I 15/02/2034         | 735 935 0,01      |
| 1 809 000 4.350%  | General Motors Financial Co Inc 09/04/2025 | 1 772 169 0,03    | 2 284 000 3.850%  | Goldman Sachs Group Inc 08/07/2024         | 2 245 126 0,03    |
| 1 496 000 2.750%  | General Motors Financial Co Inc 20/06/2025 | 1 417 654 0,02    | 2 540 000 5.700%  | Goldman Sachs Group Inc 01/11/2024         | 2 558 732 0,04    |
| 601 000 4.300%  | General Motors Financial Co Inc 13/07/2025 | 587 297 0,01      | 1 923 000 3.500%  | Goldman Sachs Group Inc 23/01/2025         | 1 871 271 0,03    |
| 2 000 000 6.050%  | General Motors Financial Co Inc 10/10/2025 | 2 033 300 0,03    | 6 421 000 3.500%  | Goldman Sachs Group Inc 01/04/2025         | 6 235 176 0,09    |
| 1 040 000 1.250%  | General Motors Financial Co Inc 08/01/2026 | 936 447 0,01      | 5 140 000 3.750%  | Goldman Sachs Group Inc 22/05/2025         | 4 991 711 0,07    |
| 2 209 000 5.250%  | General Motors Financial Co Inc 01/03/2026 | 2 209 287 0,03    | 5 458 000 3.272%  | Goldman Sachs Group Inc 29/09/2025         | 5 292 623 0,08    |
| 1 500 000 1.500%  | General Motors Financial Co Inc 10/06/2026 | 1 335 900 0,02    | 1 956 000 4.250%  | Goldman Sachs Group Inc 21/10/2025         | 1 900 137 0,03    |
| 628 000 4.000%  | General Motors Financial Co Inc 06/10/2026 | 600 538 0,01      | 400 000 0.855%  | Goldman Sachs Group Inc 12/02/2026         | 365 956 0,01      |
| 987 000 4.350%  | General Motors Financial Co Inc 17/01/2027 | 957 143 0,01      | 3 866 000 3.750%  | Goldman Sachs Group Inc 25/02/2026         | 3 760 381 0,06    |
| 2 400 000 5.000%  | General Motors Financial Co Inc 09/04/2027 | 2 373 552 0,03    | 3 550 000 3.500%  | Goldman Sachs Group Inc 16/11/2026         | 3 390 747 0,05    |
| 1 311 000 2.700%  | General Motors Financial Co Inc 20/08/2027 | 1 173 607 0,02    | 1 164 000 1.093%  | Goldman Sachs Group Inc 09/12/2026         | 1 041 768 0,02    |
| 2 000 000 6.000%  | General Motors Financial Co Inc 09/01/2028 | 2 046 660 0,03    | 437 000 5.950%  | Goldman Sachs Group Inc 15/01/2027         | 449 940 0,01      |
| 118 000 5.650%  | General Motors Financial Co Inc 17/01/2029 | 119 496 0,00      | 3 401 000 3.850%  | Goldman Sachs Group Inc 26/01/2027         | 3 283 597 0,05    |
| 2 000 000 4.300%  | General Motors Financial Co Inc 06/04/2029 | 1 863 440 0,03    | 7 000 000 1.431%  | Goldman Sachs Group Inc 09/03/2027         | 6 257 020 0,09    |
| 1 300 000 3.600%  | General Motors Financial Co Inc 21/06/2030 | 1 137 396 0,02    | 1 335 000 4.387%  | Goldman Sachs Group Inc 15/06/2027         | 1 305 029 0,02    |
| 1 387 000 2.350%  | General Motors Financial Co Inc 08/01/2031 | 1 095 550 0,02    |   |  |                   |
| 1 500 000 2.700%  | General Motors Financial Co Inc 10/06/2031 | 1 202 775 0,02    |   |  |                   |



## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets                                   | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|---|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 1 200 000   | 1.542%           | Goldman Sachs Group Inc<br>10/09/2027               | 1 056 252   | 0,02             |                   |
| 4 650 000   | 1.948%           | Goldman Sachs Group Inc<br>21/10/2027               | 4 152 589   | 0,06             |                   |
| 1 550 000   | 2.640%           | Goldman Sachs Group Inc<br>24/02/2028               | 1 415 150   | 0,02             |                   |
| 4 650 000   | 3.615%           | Goldman Sachs Group Inc<br>15/03/2028               | 4 403 085   | 0,06             |                   |
| 4 197 000   | 3.691%           | Goldman Sachs Group Inc<br>05/06/2028               | 3 982 575   | 0,06             |                   |
| 3 330 000   | 4.482%           | Goldman Sachs Group Inc<br>23/08/2028               | 3 257 876   | 0,05             |                   |
| 5 403 000   | 3.814%           | Goldman Sachs Group Inc<br>23/04/2029               | 5 082 440   | 0,07             |                   |
| 3 079 000   | 4.223%           | Goldman Sachs Group Inc<br>01/05/2029               | 2 938 008   | 0,04             |                   |
| 1 910 000   | 2.600%           | Goldman Sachs Group Inc<br>07/02/2030               | 1 640 289   | 0,02             |                   |
| 1 502 000   | 3.800%           | Goldman Sachs Group Inc<br>15/03/2030               | 1 398 993   | 0,02             |                   |
| 2 000 000   | 1.992%           | Goldman Sachs Group Inc<br>27/01/2032               | 1 595 180   | 0,02             |                   |
| 3 510 000   | 2.615%           | Goldman Sachs Group Inc<br>22/04/2032               | 2 923 725   | 0,04             |                   |
| 3 500 000   | 2.383%           | Goldman Sachs Group Inc<br>21/07/2032               | 2 847 250   | 0,04             |                   |
| 10 500 000  | 2.650%           | Goldman Sachs Group Inc<br>21/10/2032               | 8 659 035   | 0,13             |                   |
| 2 550 000   | 3.102%           | Goldman Sachs Group Inc<br>24/02/2033               | 2 185 503   | 0,03             |                   |
| 6 940 000   | 6.750%           | Goldman Sachs Group Inc<br>01/10/2037               | 7 525 736   | 0,11             |                   |
| 3 821 000   | 4.017%           | Goldman Sachs Group Inc<br>31/10/2038               | 3 303 331   | 0,05             |                   |
| 4 031 000   | 4.411%           | Goldman Sachs Group Inc<br>23/04/2039               | 3 626 313   | 0,05             |                   |
| 1 733 000   | 6.250%           | Goldman Sachs Group Inc<br>01/02/2041               | 1 909 454   | 0,03             |                   |
| 1 080 000   | 3.210%           | Goldman Sachs Group Inc<br>22/04/2042               | 813 218   | 0,01             |                   |
| 14 387 000  | 2.908%           | Goldman Sachs Group Inc<br>21/07/2042               | 10 249 756  | 0,15             |                   |
| 3 600 000   | 3.436%           | Goldman Sachs Group Inc<br>24/02/2043               | 2 773 008   | 0,04             |                   |
| 2 670 000   | 4.800%           | Goldman Sachs Group Inc<br>08/07/2044               | 2 480 911   | 0,04             |                   |
| 3 700 000   | 5.150%           | Goldman Sachs Group Inc<br>22/05/2045               | 3 514 741   | 0,05             |                   |
| 694 000   | 4.750%           | Goldman Sachs Group Inc<br>21/10/2045               | 641 228   | 0,01             |                   |
| 7 532 000   | 2.800%           | Hartford Financial Services<br>Group Inc 19/08/2029 | 6 624 921   | 0,10             |                   |
| 2 673 000   | 5.950%           | Hartford Financial Services<br>Group Inc 15/10/2036 | 2 818 572   | 0,04             |                   |
| 2 070 000   | 6.100%           | Hartford Financial Services<br>Group Inc 01/10/2041 | 2 151 434   | 0,03             |                   |
| 4 061 000   | 4.300%           | Hartford Financial Services<br>Group Inc 15/04/2043 | 3 430 570   | 0,05             |                   |
| 6 000 000   | 4.400%           | Hartford Financial Services<br>Group Inc 15/03/2048 | 5 112 900   | 0,07             |                   |
| 2 489 000   | 3.600%           | Hartford Financial Services<br>Group Inc 19/08/2049 | 1 890 868   | 0,03             |                   |
| 110 000   | 2.900%           | Hartford Financial Services<br>Group Inc 15/09/2051 | 72 591  | 0,00             |                   |
| 1 521 000   | 3.000%           | Hasbro Inc 19/11/2024                               | 1 468 313   | 0,02             |                   |
| 2 118 000   | 3.550%           | Hasbro Inc 19/11/2026                               | 1 990 009   | 0,03             |                   |
| 353 000   | 3.900%           | Hasbro Inc 19/11/2029                               | 321 474   | 0,00             |                   |
| 2 627 000   | 6.350%           | Hasbro Inc 15/03/2040                               | 2 654 163   | 0,04             |                   |
| 5 875 000   | 5.100%           | Hasbro Inc 15/05/2044                               | 5 140 625   | 0,08             |                   |
| 764 000   | 3.400%           | Healthpeak Properties Interim<br>Inc 01/02/2025     | 739 193   | 0,01             |                   |
| 4 570 000   | 4.000%           | Healthpeak Properties Interim<br>Inc 01/06/2025     | 4 471 745   | 0,07             |                   |
| 12 433 000  | 3.250%           | Healthpeak Properties Interim<br>Inc 15/07/2026     | 11 817 194  | 0,17             |                   |
| 10 325 000  | 1.350%           | Healthpeak Properties Interim<br>Inc 01/02/2027     | 9 068 757   | 0,13             |                   |
| 1 530 000   | 2.125%           | Healthpeak Properties Interim<br>Inc 01/12/2028     | 1 326 755   | 0,02             |                   |
| 14 649 000  | 3.500%           | Healthpeak Properties Interim<br>Inc 15/07/2029     | 13 382 740  | 0,20             |                   |
| 11 657 000  | 3.000%           | Healthpeak Properties Interim<br>Inc 15/01/2030     | 10 221 207  | 0,15             |                   |
| 8 373 000   | 2.875%           | Healthpeak Properties Interim<br>Inc 15/01/2031     | 7 206 557   | 0,11             |                   |
| 1 000 000   | 5.250%           | Healthpeak Properties Interim<br>Inc 15/12/2032     | 1 002 470   | 0,01             |                   |
| 4 600 000   | 6.750%           | Healthpeak Properties Interim<br>Inc 01/02/2041     | 4 873 608   | 0,07             |                   |
| 15 000  | 2.050%           | Hershey Co 15/11/2024                               | 14 468  | 0,00             |                   |
| 955 000   | 0.900%           | Hershey Co 01/06/2025                               | 885 151   | 0,01             |                   |
| 520 000   | 2.300%           | Hershey Co 15/08/2026                               | 493 995   | 0,01             |                   |
| 50 000  | 2.450%           | Hershey Co 15/11/2029                               | 44 510  | 0,00             |                   |
| 1 000 000   | 3.125%           | Hershey Co 15/11/2049                               | 760 880   | 0,01             |                   |
| 849 000   | 2.650%           | Hershey Co 01/06/2050                               | 596 745   | 0,01             |                   |
| 74 000  | 3.500%           | Hess Corp 15/07/2024                                | 72 358  | 0,00             |                   |
| 560 000   | 0.000%           | Hess Corp 01/04/2027                                | 546 235   | 0,01             |                   |
| 763 000   | 7.875%           | Hess Corp 01/10/2029                                | 860 061   | 0,01             |                   |
| 708 000   | 7.300%           | Hess Corp 15/08/2031                                | 788 110   | 0,01             |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 3 537 000 7.125% Hess Corp 15/03/2033                                   | 3 910 967        | 0,06              |
| 147 000 6.000% Hess Corp 15/01/2040                                     | 148 423          | 0,00              |
| 3 311 000 5.600% Hess Corp 15/02/2041                                   | 3 194 254        | 0,05              |
| 348 000 5.800% Hess Corp 01/04/2047                                     | 340 455          | 0,01              |
| 1 000 000 1.450% Hewlett Packard Enterprise Co 01/04/2024               | 961 960          | 0,01              |
| 1 220 000 4.900% Hewlett Packard Enterprise Co 15/10/2025               | 1 216 816        | 0,02              |
| 162 000 1.750% Hewlett Packard Enterprise Co 01/04/2026                 | 149 142          | 0,00              |
| 2 000 000 6.102% Hewlett Packard Enterprise Co 01/04/2026               | 2 022 000        | 0,03              |
| 670 000 6.200% Hewlett Packard Enterprise Co 15/10/2035                 | 718 588          | 0,01              |
| 5 075 000 6.350% Hewlett Packard Enterprise Co 15/10/2045               | 5 337 327        | 0,08              |
| 1 000 000 4.200% Highwoods Realty LP 15/04/2029                         | 849 610          | 0,01              |
| 200 000 3.050% Highwoods Realty LP 15/02/2030                           | 157 822          | 0,00              |
| 270 000 2.700% Home Depot Inc 15/04/2025                                | 261 679          | 0,00              |
| 320 000 3.350% Home Depot Inc 15/09/2025                                | 313 366          | 0,00              |
| 1 695 000 4.000% Home Depot Inc 15/09/2025                              | 1 685 745        | 0,02              |
| 2 473 000 3.000% Home Depot Inc 01/04/2026                              | 2 398 934        | 0,04              |
| 308 000 2.125% Home Depot Inc 15/09/2026                                | 288 966          | 0,00              |
| 1 483 000 2.500% Home Depot Inc 15/04/2027                              | 1 391 973        | 0,02              |
| 135 000 2.875% Home Depot Inc 15/04/2027                                | 128 683          | 0,00              |
| 407 000 2.800% Home Depot Inc 14/09/2027                                | 385 694          | 0,01              |
| 253 000 0.900% Home Depot Inc 15/03/2028                                | 215 766          | 0,00              |
| 1 305 000 3.900% Home Depot Inc 06/12/2028                              | 1 285 399        | 0,02              |
| 2 947 000 2.950% Home Depot Inc 15/06/2029                              | 2 725 356        | 0,04              |
| 2 208 000 2.700% Home Depot Inc 15/04/2030                              | 1 995 127        | 0,03              |
| 1 604 000 1.375% Home Depot Inc 15/03/2031                              | 1 284 146        | 0,02              |
| 435 000 3.250% Home Depot Inc 15/04/2032                                | 397 098          | 0,01              |
| 1 590 000 4.500% Home Depot Inc 15/09/2032                              | 1 600 367        | 0,02              |
| 2 284 000 5.875% Home Depot Inc 16/12/2036                              | 2 548 601        | 0,04              |
| 2 470 000 3.300% Home Depot Inc 15/04/2040                              | 2 055 880        | 0,03              |
| 140 000 5.400% Home Depot Inc 15/09/2040                                | 147 153          | 0,00              |
| 1 993 000 5.950% Home Depot Inc 01/04/2041                              | 2 234 472        | 0,03              |
| 255 000 4.200% Home Depot Inc 01/04/2043                                | 231 086          | 0,00              |
| 356 000 4.875% Home Depot Inc 15/02/2044                                | 352 458          | 0,01              |
| 1 500 000 4.400% Home Depot Inc 15/03/2045                              | 1 393 875        | 0,02              |
| 3 790 000 4.250% Home Depot Inc 01/04/2046                              | 3 442 571        | 0,05              |
| 3 585 000 3.900% Home Depot Inc 15/06/2047                              | 3 086 542        | 0,05              |
| 1 930 000 4.500% Home Depot Inc 06/12/2048                              | 1 817 404        | 0,03              |
| 1 377 000 3.125% Home Depot Inc 15/12/2049                              | 1 020 082        | 0,02              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 1 561 000 3.350% Home Depot Inc 15/04/2050                              | 1 210 290        | 0,02              |
| 300 000 2.375% Home Depot Inc 15/03/2051                                | 189 183          | 0,00              |
| 625 000 3.625% Home Depot Inc 15/04/2052                                | 503 181          | 0,01              |
| 1 000 000 4.950% Home Depot Inc 15/09/2052                              | 999 510          | 0,01              |
| 1 414 000 3.500% Home Depot Inc 15/09/2056                              | 1 102 185        | 0,02              |
| 1 000 000 2.271% Honda Motor Co Ltd 10/03/2025                          | 957 100          | 0,01              |
| 2 000 000 2.534% Honda Motor Co Ltd 10/03/2027                          | 1 872 300        | 0,03              |
| 1 000 000 2.967% Honda Motor Co Ltd 10/03/2032                          | 898 470          | 0,01              |
| 5 032 000 3.875% Host Hotels & Resorts LP 01/04/2024                    | 4 914 905        | 0,07              |
| 6 738 000 4.000% Host Hotels & Resorts LP 15/06/2025                    | 6 475 824        | 0,09              |
| 7 194 000 4.500% Host Hotels & Resorts LP 01/02/2026                    | 6 953 001        | 0,10              |
| 13 821 000 3.375% Host Hotels & Resorts LP 15/12/2029                   | 11 726 427       | 0,17              |
| 13 419 000 3.500% Host Hotels & Resorts LP 15/09/2030                   | 11 374 884       | 0,17              |
| 8 300 000 2.900% Host Hotels & Resorts LP 15/12/2031                    | 6 480 391        | 0,09              |
| 21 644 000 2.200% HP Inc 17/06/2025                                     | 20 413 755       | 0,30              |
| 16 500 000 1.450% HP Inc 17/06/2026                                     | 14 849 340       | 0,22              |
| 15 972 000 3.000% HP Inc 17/06/2027                                     | 14 879 355       | 0,22              |
| 4 000 000 4.750% HP Inc 15/01/2028                                      | 3 954 520        | 0,06              |
| 17 393 000 4.000% HP Inc 15/04/2029                                     | 16 495 521       | 0,24              |
| 14 402 000 3.400% HP Inc 17/06/2030                                     | 12 756 139       | 0,19              |
| 20 400 000 2.650% HP Inc 17/06/2031                                     | 16 651 704       | 0,24              |
| 12 600 000 4.200% HP Inc 15/04/2032                                     | 11 346 804       | 0,17              |
| 15 115 000 5.500% HP Inc 15/01/2033                                     | 14 976 093       | 0,22              |
| 19 687 000 6.000% HP Inc 15/09/2041                                     | 20 161 063       | 0,29              |
| 1 550 000 6.332% HSBC HLGs PLC 09/03/2044                               | 1 632 011        | 0,02              |
| 2 000 000 0.976% HSBC Holdings PLC 24/05/2025                           | 1 883 020        | 0,03              |
| 300 000 4.250% HSBC Holdings PLC 18/08/2025                             | 285 903          | 0,00              |
| 700 000 2.633% HSBC Holdings PLC 07/11/2025                             | 661 822          | 0,01              |
| 2 000 000 4.180% HSBC Holdings PLC 09/12/2025                           | 1 941 520        | 0,03              |
| 2 100 000 4.300% HSBC Holdings PLC 08/03/2026                           | 2 051 721        | 0,03              |
| 2 335 000 2.999% HSBC Holdings PLC 10/03/2026                           | 2 214 070        | 0,03              |
| 2 600 000 1.645% HSBC Holdings PLC 18/04/2026                           | 2 375 672        | 0,03              |
| 3 300 000 3.900% HSBC Holdings PLC 25/05/2026                           | 3 124 143        | 0,05              |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD                       | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets                                 |            |      |
|---|--|-------------------|---|------------------|---|------------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |   |            |      |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |   |            |      |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |  |                   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |   |            |      |
| 1 700 000   | 2.099% HSBC Holdings PLC<br>04/06/2026 | 1 562 096         | 0,02  | 400 000          | 6.800% HSBC Holdings PLC<br>01/06/2038            | 408 576    | 0,01 |
| 3 200 000   | 4.292% HSBC Holdings PLC<br>12/09/2026 | 3 062 080         | 0,04  | 300 000          | 6.100% HSBC Holdings PLC<br>14/01/2042            | 321 168    | 0,00 |
| 600 000   | 7.336% HSBC Holdings PLC<br>03/11/2026 | 624 324           | 0,01  | 3 650 000        | 5.250% HSBC Holdings PLC<br>14/03/2044            | 3 222 037  | 0,05 |
| 4 300 000   | 4.375% HSBC Holdings PLC<br>23/11/2026 | 4 107 919         | 0,06  | 380 000          | 6.161% HSBC HOLDINGS PLC<br>09/03/2029            | 391 054    | 0,01 |
| 3 550 000   | 1.589% HSBC Holdings PLC<br>24/05/2027 | 3 129 431         | 0,05  | 4 000 000        | 3.750% HSBC USA Inc 24/05/2024                    | 3 907 720  | 0,06 |
| 2 000 000   | 2.251% HSBC Holdings PLC<br>22/11/2027 | 1 771 100         | 0,03  | 1 000 000        | 3.500% HSBC USA Inc 23/06/2024                    | 971 560    | 0,01 |
| 3 000 000   | 4.041% HSBC Holdings PLC<br>13/03/2028 | 2 824 500         | 0,04  | 2 000 000        | 5.625% HSBC USA Inc 17/03/2025                    | 2 008 300  | 0,03 |
| 2 250 000   | 4.755% HSBC Holdings PLC<br>09/06/2028 | 2 178 765         | 0,03  | 2 000 000        | 5.950% Hudson Pacific Properties LP<br>15/02/2028 | 1 524 280  | 0,02 |
| 3 145 000   | 5.210% HSBC Holdings PLC<br>11/08/2028 | 3 114 894         | 0,05  | 400 000          | 4.650% Hudson Pacific Properties LP<br>01/04/2029 | 278 800    | 0,00 |
| 1 100 000   | 2.013% HSBC Holdings PLC<br>22/09/2028 | 942 524           | 0,01  | 700 000          | 3.250% Hudson Pacific Properties LP<br>15/01/2030 | 448 770    | 0,01 |
| 2 000 000   | 7.390% HSBC Holdings PLC<br>03/11/2028 | 2 137 740         | 0,03  | 836 000          | 5.810% Iberdrola International BV<br>15/03/2025   | 854 885    | 0,01 |
| 2 600 000   | 4.583% HSBC Holdings PLC<br>19/06/2029 | 2 473 016         | 0,04  | 11 440 000       | 6.750% Iberdrola International BV<br>15/07/2036   | 13 029 474 | 0,19 |
| 5 200 000   | 2.206% HSBC Holdings PLC<br>17/08/2029 | 4 372 160         | 0,06  | 551 000          | 2.650% Illinois Tool Works Inc<br>15/11/2026      | 524 277    | 0,01 |
| 2 400 000   | 4.950% HSBC Holdings PLC<br>31/03/2030 | 2 354 232         | 0,03  | 132 000          | 4.875% Illinois Tool Works Inc<br>15/09/2041      | 134 165    | 0,00 |
| 1 850 000   | 3.973% HSBC Holdings PLC<br>22/05/2030 | 1 671 919         | 0,02  | 405 000          | 3.900% Illinois Tool Works Inc<br>01/09/2042      | 365 484    | 0,01 |
| 3 000 000   | 2.848% HSBC Holdings PLC<br>04/06/2031 | 2 520 810         | 0,04  | 613 000          | 6.050% Indiana Michigan Power Co<br>15/03/2037    | 665 552    | 0,01 |
| 3 500 000   | 2.357% HSBC Holdings PLC<br>18/08/2031 | 2 823 800         | 0,04  | 1 070 000        | 4.550% Indiana Michigan Power Co<br>15/03/2046    | 945 227    | 0,01 |
| 5 500 000   | 2.804% HSBC Holdings PLC<br>24/05/2032 | 4 494 490         | 0,07  | 184 000          | 3.750% Indiana Michigan Power Co<br>01/07/2047    | 143 365    | 0,00 |
| 4 750 000   | 2.871% HSBC Holdings PLC<br>22/11/2032 | 3 869 112         | 0,06  | 465 000          | 4.250% Indiana Michigan Power Co<br>15/08/2048    | 398 491    | 0,01 |
| 4 800 000   | 4.762% HSBC Holdings PLC<br>29/03/2033 | 4 376 736         | 0,06  | 750 000          | 5.625% Indiana Michigan Power Co<br>01/04/2053    | 783 308    | 0,01 |
| 1 885 000   | 5.402% HSBC Holdings PLC<br>11/08/2033 | 1 863 115         | 0,03  | 2 238 000        | 3.550% ING Groep NV 09/04/2024                    | 2 195 747  | 0,03 |
| 3 000 000   | 8.113% HSBC Holdings PLC<br>03/11/2033 | 3 350 160         | 0,05  | 1 000 000        | 3.869% ING Groep NV 28/03/2026                    | 967 320    | 0,01 |
| 1 000 000   | 6.254% HSBC Holdings PLC<br>09/03/2034 | 1 047 880         | 0,02  | 2 511 000        | 3.950% ING Groep NV 29/03/2027                    | 2 399 537  | 0,04 |
| 2 500 000   | 6.500% HSBC Holdings PLC<br>02/05/2036 | 2 528 425         | 0,04  | 1 000 000        | 4.017% ING Groep NV 28/03/2028                    | 949 200    | 0,01 |
| 1 500 000   | 6.500% HSBC Holdings PLC<br>15/09/2037 | 1 473 780         | 0,02  | 1 847 000        | 4.550% ING Groep NV 02/10/2028                    | 1 772 418  | 0,03 |
|   |  |                   |   | 1 438 000        | 4.050% ING Groep NV 09/04/2029                    | 1 349 376  | 0,02 |
|   |  |                   |   | 1 370 000        | 4.252% ING Groep NV 28/03/2033                    | 1 251 673  | 0,02 |
|   |  |                   |   | 2 130 000        | 2.875% Intel Corp 11/05/2024                      | 2 094 216  | 0,03 |
|   |  |                   |   | 6 540 000        | 3.400% Intel Corp 25/03/2025                      | 6 427 381  | 0,09 |
|   |  |                   |   | 6 726 000        | 3.700% Intel Corp 29/07/2025                      | 6 627 818  | 0,10 |
|   |  |                   |   | 3 861 000        | 2.600% Intel Corp 19/05/2026                      | 3 669 610  | 0,05 |
|   |  |                   |   | 1 123 000        | 3.750% Intel Corp 25/03/2027                      | 1 102 606  | 0,02 |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 3 155 000 3.150% Intel Corp 11/05/2027                                  | 3 022 017        | 0,04              | 179 000 6.500% International Business Machines Corp 15/01/2028          | 195 042          | 0,00              |
| 1 000 000 3.750% Intel Corp 05/08/2027                                  | 977 110          | 0,01              | 1 000 000 4.500% International Business Machines Corp 06/02/2028        | 998 620          | 0,01              |
| 750 000 4.875% Intel Corp 10/02/2028                                    | 761 910          | 0,01              | 3 964 000 3.500% International Business Machines Corp 15/05/2029        | 3 722 473        | 0,05              |
| 3 390 000 2.450% Intel Corp 15/11/2029                                  | 2 985 031        | 0,04              | 846 000 1.950% International Business Machines Corp 15/05/2030          | 706 748          | 0,01              |
| 50 000 5.125% Intel Corp 10/02/2030                                     | 50 902           | 0,00              | 1 000 000 4.400% International Business Machines Corp 27/07/2032        | 973 620          | 0,01              |
| 2 665 000 3.900% Intel Corp 25/03/2030                                  | 2 539 985        | 0,04              | 53 000 5.875% International Business Machines Corp 29/11/2032           | 57 834           | 0,00              |
| 4 000 000 2.000% Intel Corp 12/08/2031                                  | 3 291 320        | 0,05              | 500 000 4.750% International Business Machines Corp 06/02/2033          | 496 810          | 0,01              |
| 1 000 000 4.150% Intel Corp 05/08/2032                                  | 964 580          | 0,01              | 2 504 000 4.150% International Business Machines Corp 15/05/2039        | 2 218 644        | 0,03              |
| 9 123 000 4.000% Intel Corp 15/12/2032                                  | 8 702 521        | 0,13              | 715 000 5.600% International Business Machines Corp 30/11/2039          | 738 588          | 0,01              |
| 965 000 5.200% Intel Corp 10/02/2033                                    | 981 395          | 0,01              | 530 000 2.850% International Business Machines Corp 15/05/2040          | 389 847          | 0,01              |
| 5 393 000 4.600% Intel Corp 25/03/2040                                  | 5 064 027        | 0,07              | 2 382 000 4.000% International Business Machines Corp 20/06/2042        | 2 031 822        | 0,03              |
| 4 000 000 2.800% Intel Corp 12/08/2041                                  | 2 907 640        | 0,04              | 1 081 000 4.700% International Business Machines Corp 19/02/2046        | 982 532          | 0,01              |
| 11 433 000 4.800% Intel Corp 01/10/2041                                 | 10 965 457       | 0,16              | 4 237 000 4.250% International Business Machines Corp 15/05/2049        | 3 637 707        | 0,05              |
| 7 525 000 4.250% Intel Corp 15/12/2042                                  | 6 609 508        | 0,10              | 1 619 000 2.950% International Business Machines Corp 15/05/2050        | 1 095 691        | 0,02              |
| 1 350 000 5.625% Intel Corp 10/02/2043                                  | 1 382 913        | 0,02              | 1 000 000 3.430% International Business Machines Corp 09/02/2052        | 728 180          | 0,01              |
| 7 395 000 4.900% Intel Corp 29/07/2045                                  | 7 450 536        | 0,11              | 1 000 000 4.900% International Business Machines Corp 27/07/2052        | 935 490          | 0,01              |
| 18 538 000 4.100% Intel Corp 19/05/2046                                 | 15 786 775       | 0,23              | 1 000 000 5.100% International Business Machines Corp 06/02/2053        | 955 590          | 0,01              |
| 3 458 000 4.100% Intel Corp 11/05/2047                                  | 2 927 958        | 0,04              | 1 159 000 7.125% International Business Machines Corp 01/12/2096        | 1 525 989        | 0,02              |
| 6 108 000 3.734% Intel Corp 08/12/2047                                  | 4 850 851        | 0,07              | 200 000 4.450% International Flavors & Fragrances Inc 26/09/2028        | 191 254          | 0,00              |
| 4 600 000 3.250% Intel Corp 15/11/2049                                  | 3 274 924        | 0,05              | 792 000 4.375% International Flavors & Fragrances Inc 01/06/2047        | 620 564          | 0,01              |
| 4 846 000 4.750% Intel Corp 25/03/2050                                  | 4 435 350        | 0,06              | 1 200 000 5.000% International Flavors & Fragrances Inc 26/09/2048      | 1 024 104        | 0,02              |
| 1 300 000 3.050% Intel Corp 12/08/2051                                  | 888 303          | 0,01              | 2 257 000 7.300% International Paper Co 15/11/2039                      | 2 589 546        | 0,04              |
| 1 000 000 4.900% Intel Corp 05/08/2052                                  | 931 210          | 0,01              | 540 000 6.000% International Paper Co 15/11/2041                        | 562 280          | 0,01              |
| 1 055 000 5.700% Intel Corp 10/02/2053                                  | 1 074 823        | 0,02              | 3 260 000 4.800% International Paper Co 15/06/2044                      | 2 987 105        | 0,04              |
| 507 000 3.100% Intel Corp 15/02/2060                                    | 333 479          | 0,00              | 448 000 4.350% International Paper Co 15/08/2048                        | 388 653          | 0,01              |
| 2 020 000 4.950% Intel Corp 25/03/2060                                  | 1 874 338        | 0,03              |   |                  |                   |
| 2 050 000 3.200% Intel Corp 12/08/2061                                  | 1 354 866        | 0,02              |   |                  |                   |
| 1 000 000 5.050% Intel Corp 05/08/2062                                  | 926 100          | 0,01              |   |                  |                   |
| 250 000 5.900% Intel Corp 10/02/2063                                    | 257 070          | 0,00              |   |                  |                   |
| 3 475 000 3.000% International Business Machines Corp 15/05/2024        | 3 410 956        | 0,05              |   |                  |                   |
| 1 000 000 4.000% International Business Machines Corp 27/07/2025        | 988 690          | 0,01              |   |                  |                   |
| 847 000 7.000% International Business Machines Corp 30/10/2025          | 896 821          | 0,01              |   |                  |                   |
| 1 275 000 3.450% International Business Machines Corp 19/02/2026        | 1 238 114        | 0,02              |   |                  |                   |
| 2 290 000 3.300% International Business Machines Corp 15/05/2026        | 2 207 926        | 0,03              |   |                  |                   |
| 250 000 3.300% International Business Machines Corp 27/01/2027          | 239 540          | 0,00              |   |                  |                   |
| 5 120 000 1.700% International Business Machines Corp 15/05/2027        | 4 587 776        | 0,07              |   |                  |                   |
| 1 000 000 4.150% International Business Machines Corp 27/07/2027        | 989 270          | 0,01              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets   | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|---|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 1 327 000   | 3.250%           | Interstate Power and Light Co<br>01/12/2024                             | 1 288 716   | 0,02             |                   |
| 1 287 000   | 2.300%           | Interstate Power and Light Co<br>01/06/2030                             | 1 080 282   | 0,02             |                   |
| 366 000   | 3.700%           | Interstate Power and Light Co<br>15/09/2046                             | 282 160   | 0,00             |                   |
| 266 000   | 3.500%           | Interstate Power and Light Co<br>30/09/2049                             | 199 104   | 0,00             |                   |
| 1 250 000   | 3.100%           | Interstate Power and Light Co<br>30/11/2051                             | 856 750   | 0,01             |                   |
| 300 000   | 5.375%           | Invesco Finance PLC<br>30/11/2043                                       | 296 790   | 0,00             |                   |
| 7 000   | 3.700%           | IPALCO Enterprises Inc<br>01/09/2024                                    | 6 819   | 0,00             |                   |
| 2 450 000   | 4.250%           | IPALCO Enterprises Inc<br>01/05/2030                                    | 2 249 614   | 0,03             |                   |
| 50 000  | 2.500%           | JBS USA LUX SA / JBS USA<br>Food Co / JBS USA Finance Inc<br>15/01/2027 | 44 057  | 0,00             |                   |
| 1 950 000   | 5.125%           | JBS USA LUX SA / JBS USA<br>Food Co / JBS USA Finance Inc<br>01/02/2028 | 1 887 775   | 0,03             |                   |
| 50 000  | 3.000%           | JBS USA LUX SA / JBS USA<br>Food Co / JBS USA Finance Inc<br>02/02/2029 | 42 836  | 0,00             |                   |
| 500 000   | 5.500%           | JBS USA LUX SA / JBS USA<br>Food Co / JBS USA Finance Inc<br>15/01/2030 | 477 575   | 0,01             |                   |
| 2 000 000   | 3.625%           | JBS USA LUX SA / JBS USA<br>Food Co / JBS USA Finance Inc<br>15/01/2032 | 1 651 660   | 0,02             |                   |
| 1 650 000   | 3.000%           | JBS USA LUX SA / JBS USA<br>Food Co / JBS USA Finance Inc<br>15/05/2032 | 1 296 636   | 0,02             |                   |
| 665 000   | 5.750%           | JBS USA LUX SA / JBS USA<br>Food Co / JBS USA Finance Inc<br>01/04/2033 | 638 739   | 0,01             |                   |
| 1 500 000   | 4.375%           | JBS USA LUX SA / JBS USA<br>Food Co / JBS USA Finance Inc<br>02/02/2052 | 1 086 285   | 0,02             |                   |
| 1 965 000   | 6.500%           | JBS USA LUX SA / JBS USA<br>Food Co / JBS USA Finance Inc<br>01/12/2052 | 1 883 570   | 0,03             |                   |
| 869 126   | 4.000%           | JetBlue 2020-1 Class A Pass<br>Through Trust 15/05/2034                 | 798 223   | 0,01             |                   |
| 455 000   | 0.450%           | John Deere Capital Corp<br>07/06/2024                                   | 433 287   | 0,01             |                   |
| 500 000   | 2.650%           | John Deere Capital Corp<br>24/06/2024                                   | 487 940   | 0,01             |                   |
| 500 000   | 0.625%           | John Deere Capital Corp<br>10/09/2024                                   | 473 645   | 0,01             |                   |
| 555 000   | 4.550%           | John Deere Capital Corp<br>11/10/2024                                   | 555 866   | 0,01             |                   |
| 1 300 000   | 5.150%           | John Deere Capital Corp<br>03/03/2025                                   | 1 316 874   | 0,02             |                   |
| 2 700 000   | 3.450%           | John Deere Capital Corp<br>13/03/2025                                   | 2 656 368   | 0,04             |                   |
| 1 110 000   | 3.400%           | John Deere Capital Corp<br>06/06/2025                                   | 1 087 079   | 0,02             |                   |
| 1 300 000   | 4.050%           | John Deere Capital Corp<br>08/09/2025                                   | 1 292 603   | 0,02             |                   |
| 1 000 000   | 4.800%           | John Deere Capital Corp<br>09/01/2026                                   | 1 015 210   | 0,01             |                   |
| 1 300 000   | 5.050%           | John Deere Capital Corp<br>03/03/2026                                   | 1 323 673   | 0,02             |                   |
| 1 500 000   | 1.050%           | John Deere Capital Corp<br>17/06/2026                                   | 1 355 220   | 0,02             |                   |
| 100 000   | 2.250%           | John Deere Capital Corp<br>14/09/2026                                   | 93 431  | 0,00             |                   |
| 400 000   | 2.350%           | John Deere Capital Corp<br>08/03/2027                                   | 371 916   | 0,01             |                   |
| 2 000 000   | 1.750%           | John Deere Capital Corp<br>09/03/2027                                   | 1 822 560   | 0,03             |                   |
| 1 000 000   | 4.150%           | John Deere Capital Corp<br>15/09/2027                                   | 994 790   | 0,01             |                   |
| 1 060 000   | 4.750%           | John Deere Capital Corp<br>20/01/2028                                   | 1 082 525   | 0,02             |                   |
| 1 300 000   | 4.900%           | John Deere Capital Corp<br>03/03/2028                                   | 1 336 140   | 0,02             |                   |
| 3 000 000   | 1.500%           | John Deere Capital Corp<br>06/03/2028                                   | 2 637 660   | 0,04             |                   |
| 1 000 000   | 3.450%           | John Deere Capital Corp<br>07/03/2029                                   | 963 090   | 0,01             |                   |
| 4 000 000   | 3.350%           | John Deere Capital Corp<br>18/04/2029                                   | 3 797 640   | 0,06             |                   |
| 1 000 000   | 4.850%           | John Deere Capital Corp<br>11/10/2029                                   | 1 034 060   | 0,02             |                   |
| 50 000  | 2.450%           | John Deere Capital Corp<br>09/01/2030                                   | 44 483  | 0,00             |                   |
| 1 500 000   | 2.000%           | John Deere Capital Corp<br>17/06/2031                                   | 1 253 070   | 0,02             |                   |
| 400 000   | 3.900%           | John Deere Capital Corp<br>07/06/2032                                   | 385 200   | 0,01             |                   |
| 750 000   | 4.350%           | John Deere Capital Corp<br>15/09/2032                                   | 749 010   | 0,01             |                   |
| 750 000   | 2.625%           | Johnson & Johnson 15/01/2025  | 732 615   | 0,01             |                   |
| 180 000   | 2.450%           | Johnson & Johnson 01/03/2026  | 173 081   | 0,00             |                   |
| 1 650 000   | 2.950%           | Johnson & Johnson 03/03/2027  | 1 597 249   | 0,02             |                   |
| 3 000 000   | 0.950%           | Johnson & Johnson 01/09/2027  | 2 657 610   | 0,04             |                   |
| 2 000 000   | 2.900%           | Johnson & Johnson 15/01/2028  | 1 917 360   | 0,03             |                   |
| 350 000   | 1.300%           | Johnson & Johnson 01/09/2030  | 293 360   | 0,00             |                   |
| 350 000   | 4.950%           | Johnson & Johnson 15/05/2033  | 379 120   | 0,01             |                   |
| 700 000   | 4.375%           | Johnson & Johnson 05/12/2033  | 720 377   | 0,01             |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets  | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets              |
|---|------------------|--|---|------------------|--------------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |  | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                                |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |  | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                                |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |  | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                                |
| 3 000 000   | 3.625%           | Johnson & Johnson 03/03/2037   | 3 000 000   | 1.561%           | JPMorgan Chase & Co 10/12/2025 |
| 1 700 000   | 5.950%           | Johnson & Johnson 15/08/2037   |   | 2 811 510        | 0,04                           |
| 1 200 000   | 3.400%           | Johnson & Johnson 15/01/2038   | 2 000 000   | 5.546%           | JPMorgan Chase & Co 15/12/2025 |
| 545 000   | 5.850%           | Johnson & Johnson 15/07/2038   |   | 2 013 300        | 0,03                           |
| 4 000 000   | 2.100%           | Johnson & Johnson 01/09/2040   | 3 798 000   | 2.005%           | JPMorgan Chase & Co 13/03/2026 |
| 150 000   | 4.850%           | Johnson & Johnson 15/05/2041   |   | 3 577 830        | 0,05                           |
| 70 000  | 4.500%           | Johnson & Johnson 05/12/2043   | 4 025 000   | 3.300%           | JPMorgan Chase & Co 01/04/2026 |
| 4 310 000   | 3.700%           | Johnson & Johnson 01/03/2046   |   | 3 884 769        | 0,06                           |
| 1 800 000   | 2.250%           | Johnson & Johnson 01/09/2050   | 5 898 000   | 2.083%           | JPMorgan Chase & Co 22/04/2026 |
| 4 900 000   | 2.450%           | Johnson & Johnson 01/09/2060   |   | 5 538 930        | 0,08                           |
| 2 040 000   | 3.900%           | Johnson Controls International plc 14/02/2026                                    | 1 900 000   | 4.080%           | JPMorgan Chase & Co 26/04/2026 |
| 80 000  | 4.625%           | Johnson Controls International plc 02/07/2044                                    |   | 1 863 805        | 0,03                           |
| 1 380 000   | 5.125%           | Johnson Controls International plc 14/09/2045                                    | 3 666 000   | 3.200%           | JPMorgan Chase & Co 15/06/2026 |
| 3 870 000   | 4.500%           | Johnson Controls International plc 15/02/2047                                    |   | 3 520 020        | 0,05                           |
| 2 210 000   | 4.950%           | Johnson Controls International plc 02/07/2064                                    | 3 472 000   | 2.950%           | JPMorgan Chase & Co 01/10/2026 |
| 7 405 000   | 1.750%           | Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA 15/09/2030 | 328 000   | 7.625%           | JPMorgan Chase & Co 15/10/2026 |
| 7 370 000   | 2.000%           | Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA 16/09/2031 |   | 356 546          | 0,01                           |
| 800 000   | 4.900%           | Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA 01/12/2032 | 4 244 000   | 1.045%           | JPMorgan Chase & Co 19/11/2026 |
| 1 773 000   | 3.625%           | JPMorgan Chase & Co 13/05/2024   |   | 3 794 560        | 0,06                           |
| 6 481 000   | 3.875%           | JPMorgan Chase & Co 10/09/2024   | 2 153 000   | 4.125%           | JPMorgan Chase & Co 15/12/2026 |
| 2 719 000   | 3.125%           | JPMorgan Chase & Co 23/01/2025   |   | 2 102 340        | 0,03                           |
| 3 010 000   | 0.824%           | JPMorgan Chase & Co 01/06/2025   | 2 905 000   | 3.960%           | JPMorgan Chase & Co 29/01/2027 |
| 3 075 000   | 3.845%           | JPMorgan Chase & Co 14/06/2025   |   | 2 818 838        | 0,04                           |
| 3 350 000   | 0.969%           | JPMorgan Chase & Co 23/06/2025   | 5 000 000   | 1.040%           | JPMorgan Chase & Co 04/02/2027 |
| 6 071 000   | 3.900%           | JPMorgan Chase & Co 15/07/2025   |   | 4 462 600        | 0,07                           |
| 200 000   | 7.750%           | JPMorgan Chase & Co 15/07/2025   | 7 560 000   | 1.578%           | JPMorgan Chase & Co 22/04/2027 |
| 1 050 000   | 0.768%           | JPMorgan Chase & Co 09/08/2025   |   | 6 791 526        | 0,10                           |
| 2 766 000   | 2.301%           | JPMorgan Chase & Co 15/10/2025   | 3 090 000   | 8.000%           | JPMorgan Chase & Co 29/04/2027 |
|   |                  |  | 3 300 000   | 1.470%           | JPMorgan Chase & Co 22/09/2027 |
|   |                  |  |   | 2 916 936        | 0,04                           |
|   |                  |  | 1 749 000   | 4.250%           | JPMorgan Chase & Co 01/10/2027 |
|   |                  |  |   | 1 715 856        | 0,03                           |
|   |                  |  | 1 586 000   | 3.625%           | JPMorgan Chase & Co 01/12/2027 |
|   |                  |  |   | 1 517 120        | 0,02                           |
|   |                  |  | 6 069 000   | 3.782%           | JPMorgan Chase & Co 01/02/2028 |
|   |                  |  |   | 5 808 276        | 0,09                           |
|   |                  |  | 2 000 000   | 2.947%           | JPMorgan Chase & Co 24/02/2028 |
|   |                  |  |   | 1 855 640        | 0,03                           |
|   |                  |  | 5 000 000   | 4.323%           | JPMorgan Chase & Co 26/04/2028 |
|   |                  |  |   | 4 884 150        | 0,07                           |
|   |                  |  | 3 827 000   | 3.540%           | JPMorgan Chase & Co 01/05/2028 |
|   |                  |  |   | 3 620 686        | 0,05                           |
|   |                  |  | 1 552 000   | 2.182%           | JPMorgan Chase & Co 01/06/2028 |
|   |                  |  |   | 1 391 290        | 0,02                           |
|   |                  |  | 4 650 000   | 4.851%           | JPMorgan Chase & Co 25/07/2028 |
|   |                  |  |   | 4 642 513        | 0,07                           |
|   |                  |  | 3 769 000   | 3.509%           | JPMorgan Chase & Co 23/01/2029 |
|   |                  |  |   | 3 529 895        | 0,05                           |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD                         | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets                         |            |      |
|---|--|-------------------|---|------------------|---|------------|------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |   |            |      |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |   |            |      |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |  |                   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |   |            |      |
| 3 058 000   | 4.005% JPMorgan Chase & Co<br>23/04/2029 | 2 922 194         | 0,04  | 2 653 000        | 5.400% JPMorgan Chase & Co<br>06/01/2042  | 2 726 117  | 0,04 |
| 835 000   | 2.069% JPMorgan Chase & Co<br>01/06/2029 | 723 118           | 0,01  | 1 850 000        | 3.157% JPMorgan Chase & Co<br>22/04/2042  | 1 407 998  | 0,02 |
| 2 492 000   | 4.203% JPMorgan Chase & Co<br>23/07/2029 | 2 406 599         | 0,04  | 13 828 000       | 5.625% JPMorgan Chase & Co<br>16/08/2043  | 14 251 790 | 0,21 |
| 2 722 000   | 4.452% JPMorgan Chase & Co<br>05/12/2029 | 2 644 260         | 0,04  | 2 423 000        | 4.850% JPMorgan Chase & Co<br>01/02/2044  | 2 329 569  | 0,03 |
| 1 860 000   | 3.702% JPMorgan Chase & Co<br>06/05/2030 | 1 730 525         | 0,03  | 18 978 000       | 4.950% JPMorgan Chase & Co<br>01/06/2045  | 17 966 400 | 0,26 |
| 2 385 000   | 4.565% JPMorgan Chase & Co<br>14/06/2030 | 2 321 535         | 0,03  | 4 680 000        | 4.260% JPMorgan Chase & Co<br>22/02/2048  | 4 084 844  | 0,06 |
| 1 455 000   | 8.750% JPMorgan Chase & Co<br>01/09/2030 | 1 739 176         | 0,03  | 2 820 000        | 4.032% JPMorgan Chase & Co<br>24/07/2048  | 2 372 494  | 0,03 |
| 3 311 000   | 2.739% JPMorgan Chase & Co<br>15/10/2030 | 2 889 344         | 0,04  | 11 589 000       | 3.964% JPMorgan Chase & Co<br>15/11/2048  | 9 605 690  | 0,14 |
| 5 665 000   | 4.493% JPMorgan Chase & Co<br>24/03/2031 | 5 508 193         | 0,08  | 22 566 000       | 3.897% JPMorgan Chase & Co<br>23/01/2049  | 18 474 488 | 0,27 |
| 2 844 000   | 2.522% JPMorgan Chase & Co<br>22/04/2031 | 2 432 559         | 0,04  | 7 460 000        | 3.109% JPMorgan Chase & Co<br>22/04/2051  | 5 285 634  | 0,08 |
| 3 540 000   | 2.956% JPMorgan Chase & Co<br>13/05/2031 | 3 048 506         | 0,04  | 5 260 000        | 3.328% JPMorgan Chase & Co<br>22/04/2052  | 3 853 844  | 0,06 |
| 1 374 000   | 1.764% JPMorgan Chase & Co<br>19/11/2031 | 1 095 902         | 0,02  | 600 000          | 5.950% Juniper Networks Inc<br>15/03/2041 | 607 500    | 0,01 |
| 5 700 000   | 1.953% JPMorgan Chase & Co<br>04/02/2032 | 4 585 125         | 0,07  | 491 000          | 3.250% Kellogg Co 01/04/2026              | 470 373    | 0,01 |
| 4 800 000   | 2.580% JPMorgan Chase & Co<br>22/04/2032 | 4 043 184         | 0,06  | 575 000          | 3.400% Kellogg Co 15/11/2027              | 548 562    | 0,01 |
| 2 500 000   | 2.545% JPMorgan Chase & Co<br>08/11/2032 | 2 075 250         | 0,03  | 1 030 000        | 4.300% Kellogg Co 15/05/2028              | 1 018 742  | 0,01 |
| 3 500 000   | 2.963% JPMorgan Chase & Co<br>25/01/2033 | 2 995 895         | 0,04  | 600 000          | 2.100% Kellogg Co 01/06/2030              | 502 788    | 0,01 |
| 2 700 000   | 4.586% JPMorgan Chase & Co<br>26/04/2033 | 2 616 354         | 0,04  | 3 118 000        | 7.450% Kellogg Co 01/04/2031              | 3 593 651  | 0,05 |
| 4 300 000   | 4.912% JPMorgan Chase & Co<br>25/07/2033 | 4 275 361         | 0,06  | 715 000          | 5.250% Kellogg Co 01/03/2033              | 733 547    | 0,01 |
| 3 840 000   | 5.717% JPMorgan Chase & Co<br>14/09/2033 | 3 917 990         | 0,06  | 1 032 000        | 4.500% Kellogg Co 01/04/2046              | 950 049    | 0,01 |
| 6 999 000   | 6.400% JPMorgan Chase & Co<br>15/05/2038 | 7 975 291         | 0,12  | 1 940 000        | 4.417% Keurig Dr Pepper Inc<br>25/05/2025 | 1 918 330  | 0,03 |
| 5 166 000   | 3.882% JPMorgan Chase & Co<br>24/07/2038 | 4 548 560         | 0,07  | 50 000           | 3.400% Keurig Dr Pepper Inc<br>15/11/2025 | 48 090     | 0,00 |
| 5 850 000   | 5.500% JPMorgan Chase & Co<br>15/10/2040 | 6 040 417         | 0,09  | 700 000          | 2.550% Keurig Dr Pepper Inc<br>15/09/2026 | 649 138    | 0,01 |
| 6 570 000   | 3.109% JPMorgan Chase & Co<br>22/04/2041 | 5 016 129         | 0,07  | 700 000          | 4.597% Keurig Dr Pepper Inc<br>25/05/2028 | 698 509    | 0,01 |
| 3 628 000   | 5.600% JPMorgan Chase & Co<br>15/07/2041 | 3 785 419         | 0,06  | 1 550 000        | 3.950% Keurig Dr Pepper Inc<br>15/04/2029 | 1 486 124  | 0,02 |
| 2 020 000   | 2.525% JPMorgan Chase & Co<br>19/11/2041 | 1 413 798         | 0,02  | 750 000          | 3.200% Keurig Dr Pepper Inc<br>01/05/2030 | 683 925    | 0,01 |
|   |  |                   |   | 1 200 000        | 4.050% Keurig Dr Pepper Inc<br>15/04/2032 | 1 136 748  | 0,02 |
|   |  |                   |   | 279 000          | 4.500% Keurig Dr Pepper Inc<br>15/11/2045 | 250 096    | 0,00 |
|   |  |                   |   | 1 000 000        | 5.085% Keurig Dr Pepper Inc<br>25/05/2048 | 960 360    | 0,01 |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets                           | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|---|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 2 000 000   | 3.800%           | Keurig Dr Pepper Inc 01/05/2050             | 1 593 060   | 0,02             |                   |
| 715 000   | 4.500%           | Keurig Dr Pepper Inc 15/04/2052             | 635 535   | 0,01             |                   |
| 31 000  | 4.550%           | Keysight Technologies Inc 30/10/2024        | 30 666  | 0,00             |                   |
| 1 156 000   | 4.600%           | Keysight Technologies Inc 06/04/2027        | 1 144 660   | 0,02             |                   |
| 2 345 000   | 3.000%           | Keysight Technologies Inc 30/10/2029        | 2 074 106   | 0,03             |                   |
| 7 541 000   | 3.450%           | Kilroy Realty LP 15/12/2024                 | 6 783 884   | 0,10             |                   |
| 595 000   | 4.375%           | Kilroy Realty LP 01/10/2025                 | 539 778   | 0,01             |                   |
| 6 700 000   | 4.750%           | Kilroy Realty LP 15/12/2028                 | 5 685 620   | 0,08             |                   |
| 8 780 000   | 4.250%           | Kilroy Realty LP 15/08/2029                 | 7 304 960   | 0,11             |                   |
| 10 050 000  | 3.050%           | Kilroy Realty LP 15/02/2030                 | 7 350 570   | 0,11             |                   |
| 7 645 000   | 2.500%           | Kilroy Realty LP 15/11/2032                 | 4 819 255   | 0,07             |                   |
| 7 995 000   | 2.650%           | Kilroy Realty LP 15/11/2033                 | 4 966 174   | 0,07             |                   |
| 210 000   | 2.750%           | Kimberly-Clark Corp 15/02/2026              | 202 482   | 0,00             |                   |
| 3 386 000   | 1.050%           | Kimberly-Clark Corp 15/09/2027              | 2 967 964   | 0,04             |                   |
| 378 000   | 3.200%           | Kimberly-Clark Corp 25/04/2029              | 358 140   | 0,01             |                   |
| 714 000   | 3.100%           | Kimberly-Clark Corp 26/03/2030              | 662 185   | 0,01             |                   |
| 2 850 000   | 4.500%           | Kimberly-Clark Corp 16/02/2033              | 2 886 679   | 0,04             |                   |
| 4 689 000   | 6.625%           | Kimberly-Clark Corp 01/08/2037              | 5 721 658   | 0,08             |                   |
| 4 684 000   | 5.300%           | Kimberly-Clark Corp 01/03/2041              | 4 978 577   | 0,07             |                   |
| 1 758 000   | 3.200%           | Kimberly-Clark Corp 30/07/2046              | 1 361 993   | 0,02             |                   |
| 667 000   | 2.875%           | Kimberly-Clark Corp 07/02/2050              | 490 719   | 0,01             |                   |
| 500 000   | 4.300%           | Kinder Morgan Energy Partners LP 01/05/2024 | 495 205   | 0,01             |                   |
| 400 000   | 6.950%           | Kinder Morgan Energy Partners LP 15/01/2038 | 447 688   | 0,01             |                   |
| 2 000 000   | 6.500%           | Kinder Morgan Energy Partners LP 01/09/2039 | 2 097 280   | 0,03             |                   |
| 790 000   | 6.550%           | Kinder Morgan Energy Partners LP 15/09/2040 | 812 081   | 0,01             |                   |
| 1 210 000   | 7.500%           | Kinder Morgan Energy Partners LP 15/11/2040 | 1 371 124   | 0,02             |                   |
| 700 000   | 6.375%           | Kinder Morgan Energy Partners LP 01/03/2041 | 722 022   | 0,01             |                   |
| 450 000   | 5.625%           | Kinder Morgan Energy Partners LP 01/09/2041 | 425 601   | 0,01             |                   |
| 1 400 000   | 5.000%           | Kinder Morgan Energy Partners LP 15/08/2042 | 1 247 106   | 0,02             |                   |
| 400 000   | 4.700%           | Kinder Morgan Energy Partners LP 01/11/2042 | 341 976   | 0,01             |                   |
| 1 000 000   | 5.000%           | Kinder Morgan Energy Partners LP 01/03/2043 | 880 010   | 0,01             |                   |
| 1 500 000   | 5.400%           | Kinder Morgan Energy Partners LP 01/09/2044 | 1 386 960   | 0,02             |                   |
| 3 865 000   | 4.300%           | Kinder Morgan Inc 01/06/2025                | 3 807 566   | 0,06             |                   |
| 1 000 000   | 1.750%           | Kinder Morgan Inc 15/11/2026                | 900 980   | 0,01             |                   |
| 1 500 000   | 4.300%           | Kinder Morgan Inc 01/03/2028                | 1 474 110   | 0,02             |                   |
| 1 000 000   | 2.000%           | Kinder Morgan Inc 15/02/2031                | 807 110   | 0,01             |                   |
| 200 000   | 7.800%           | Kinder Morgan Inc 01/08/2031                | 229 130   | 0,00             |                   |
| 550 000   | 7.750%           | Kinder Morgan Inc 15/01/2032                | 639 265   | 0,01             |                   |
| 1 500 000   | 4.800%           | Kinder Morgan Inc 01/02/2033                | 1 447 140   | 0,02             |                   |
| 2 000 000   | 5.300%           | Kinder Morgan Inc 01/12/2034                | 1 963 700   | 0,03             |                   |
| 2 137 000   | 5.550%           | Kinder Morgan Inc 01/06/2045                | 2 026 688   | 0,03             |                   |
| 1 000 000   | 5.200%           | Kinder Morgan Inc 01/03/2048                | 897 420   | 0,01             |                   |
| 500 000   | 3.250%           | Kinder Morgan Inc 01/08/2050                | 330 560   | 0,00             |                   |
| 2 000 000   | 3.600%           | Kinder Morgan Inc 15/02/2051                | 1 416 520   | 0,02             |                   |
| 1 670 000   | 5.450%           | Kinder Morgan Inc 01/08/2052                | 1 552 866   | 0,02             |                   |
| 962 000   | 4.500%           | Kinross Gold Corp 15/07/2027                | 941 288   | 0,01             |                   |
| 8 254 000   | 8.375%           | Koninklijke KPN NV 01/10/2030               | 9 843 803   | 0,14             |                   |
| 3 218 000   | 6.875%           | Koninklijke Philips NV 11/03/2038           | 3 715 471   | 0,05             |                   |
| 3 650 000   | 5.000%           | Koninklijke Philips NV 15/03/2042           | 3 407 092   | 0,05             |                   |
| 220 000   | 3.500%           | Kroger Co 01/02/2026                        | 214 698   | 0,00             |                   |
| 1 825 000   | 2.650%           | Kroger Co 15/10/2026                        | 1 718 913   | 0,03             |                   |
| 400 000   | 2.200%           | Kroger Co 01/05/2030                        | 335 572   | 0,01             |                   |
| 750 000   | 6.900%           | Kroger Co 15/04/2038                        | 855 150   | 0,01             |                   |
| 590 000   | 5.000%           | Kroger Co 15/04/2042                        | 552 541   | 0,01             |                   |
| 450 000   | 5.150%           | Kroger Co 01/08/2043                        | 427 595   | 0,01             |                   |
| 1 000 000   | 3.875%           | Kroger Co 15/10/2046                        | 787 180   | 0,01             |                   |
| 2 000 000   | 4.450%           | Kroger Co 01/02/2047                        | 1 761 380   | 0,03             |                   |
| 500 000   | 4.650%           | Kroger Co 15/01/2048                        | 448 165   | 0,01             |                   |
| 3 400 000   | 3.950%           | Kroger Co 15/01/2050                        | 2 767 940   | 0,04             |                   |
| 4 038 000   | 7.125%           | Lafarge SA 15/07/2036                       | 4 422 660   | 0,06             |                   |
| 780 000   | 3.500%           | Lear Corp 30/05/2030                        | 688 038   | 0,01             |                   |
| 1 825 000   | 2.600%           | Lear Corp 15/01/2032                        | 1 426 767   | 0,02             |                   |
| 4 220 000   | 8.500%           | Legrand France SA 15/02/2025                | 4 510 378   | 0,07             |                   |
| 218 000   | 2.650%           | Linde Inc/CT 05/02/2025                     | 210 619   | 0,00             |                   |
| 35 000  | 3.200%           | Linde Inc/CT 30/01/2026                     | 34 220  | 0,00             |                   |
| 4 306 000   | 1.100%           | Linde Inc/CT 10/08/2030                     | 3 438 470   | 0,05             |                   |
| 1 375 000   | 2.000%           | Linde Inc/CT 10/08/2050                     | 815 760   | 0,01             |                   |
| 325 000   | 3.500%           | Lloyds Bank PLC 14/05/2025                  | 312 585   | 0,00             |                   |
| 15 961 000  | 4.500%           | Lloyds Banking Group PLC 04/11/2024         | 15 364 857  | 0,22             |                   |
| 1 240 000   | 4.450%           | Lloyds Banking Group PLC 08/05/2025         | 1 211 778   | 0,02             |                   |
| 3 280 000   | 3.870%           | Lloyds Banking Group PLC 09/07/2025         | 3 188 521   | 0,05             |                   |



## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets                   | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                                     | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                                     | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                                     | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 23 360 000  | 4.582%           | Lloyds Banking Group PLC 10/12/2025 | 22 185 226  | 0,32             |                   |
| 1 370 000   | 2.438%           | Lloyds Banking Group PLC 05/02/2026 | 1 288 869   | 0,02             |                   |
| 2 000 000   | 3.511%           | Lloyds Banking Group PLC 18/03/2026 | 1 903 660   | 0,03             |                   |
| 23 157 000  | 4.650%           | Lloyds Banking Group PLC 24/03/2026 | 22 041 759  | 0,32             |                   |
| 880 000   | 4.716%           | Lloyds Banking Group PLC 11/08/2026 | 856 214   | 0,01             |                   |
| 16 342 000  | 3.750%           | Lloyds Banking Group PLC 11/01/2027 | 15 303 302  | 0,22             |                   |
| 4 951 000   | 1.627%           | Lloyds Banking Group PLC 11/05/2027 | 4 370 545   | 0,06             |                   |
| 2 400 000   | 3.750%           | Lloyds Banking Group PLC 18/03/2028 | 2 230 752   | 0,03             |                   |
| 4 801 000   | 4.375%           | Lloyds Banking Group PLC 22/03/2028 | 4 568 103   | 0,07             |                   |
| 748 000   | 4.550%           | Lloyds Banking Group PLC 16/08/2028 | 716 684   | 0,01             |                   |
| 3 428 000   | 3.574%           | Lloyds Banking Group PLC 07/11/2028 | 3 134 906   | 0,05             |                   |
| 2 050 000   | 5.871%           | Lloyds Banking Group PLC 06/03/2029 | 2 067 937   | 0,03             |                   |
| 1 500 000   | 4.976%           | Lloyds Banking Group PLC 11/08/2033 | 1 436 775   | 0,02             |                   |
| 2 395 000   | 7.953%           | Lloyds Banking Group PLC 15/11/2033 | 2 648 128   | 0,04             |                   |
| 13 100 000  | 5.300%           | Lloyds Banking Group PLC 01/12/2045 | 11 685 986  | 0,17             |                   |
| 13 650 000  | 3.369%           | Lloyds Banking Group PLC 14/12/2046 | 9 143 589   | 0,13             |                   |
| 21 430 000  | 4.344%           | Lloyds Banking Group PLC 09/01/2048 | 16 611 893  | 0,24             |                   |
| 3 287 000   | 4.000%           | Lowe's Cos Inc 15/04/2025           | 3 242 395   | 0,05             |                   |
| 580 000   | 4.400%           | Lowe's Cos Inc 08/09/2025           | 576 329   | 0,01             |                   |
| 57 000  | 3.375%           | Lowe's Cos Inc 15/09/2025           | 55 239  | 0,00             |                   |
| 400 000   | 4.800%           | Lowe's Cos Inc 01/04/2026           | 402 380   | 0,01             |                   |
| 2 692 000   | 2.500%           | Lowe's Cos Inc 15/04/2026           | 2 537 398   | 0,04             |                   |
| 355 000   | 3.350%           | Lowe's Cos Inc 01/04/2027           | 340 832   | 0,01             |                   |
| 2 055 000   | 3.100%           | Lowe's Cos Inc 03/05/2027           | 1 951 675   | 0,03             |                   |
| 422 000   | 1.300%           | Lowe's Cos Inc 15/04/2028           | 362 544   | 0,01             |                   |
| 668 000   | 3.650%           | Lowe's Cos Inc 05/04/2029           | 631 748   | 0,01             |                   |
| 771 000   | 4.500%           | Lowe's Cos Inc 15/04/2030           | 761 324   | 0,01             |                   |
| 530 000   | 1.700%           | Lowe's Cos Inc 15/10/2030           | 429 274   | 0,01             |                   |
| 3 610 000   | 2.625%           | Lowe's Cos Inc 01/04/2031           | 3 082 074   | 0,05             |                   |
| 1 000 000   | 3.750%           | Lowe's Cos Inc 01/04/2032           | 917 620   | 0,01             |                   |
| 1 335 000   | 5.000%           | Lowe's Cos Inc 15/04/2033           | 1 333 505   | 0,02             |                   |
| 1 000 000   | 5.150%           | Lowe's Cos Inc 01/07/2033           | 1 011 060   | 0,01             |                   |
| 75 000  | 5.000%           | Lowe's Cos Inc 15/04/2040           | 71 219  | 0,00             |                   |
| 1 167 000   | 4.650%           | Lowe's Cos Inc 15/04/2042           | 1 039 657   | 0,02             |                   |
| 1 370 000   | 4.375%           | Lowe's Cos Inc 15/09/2045           | 1 151 417   | 0,02             |                   |
| 2 123 000   | 3.700%           | Lowe's Cos Inc 15/04/2046           | 1 623 012   | 0,02             |                   |
| 2 853 000   | 4.050%           | Lowe's Cos Inc 03/05/2047           | 2 307 906   | 0,03             |                   |
| 1 000 000   | 5.125%           | Lowe's Cos Inc 15/04/2050           | 942 930   | 0,01             |                   |
| 3 872 000   | 3.000%           | Lowe's Cos Inc 15/10/2050           | 2 570 543   | 0,04             |                   |
| 750 000   | 3.500%           | Lowe's Cos Inc 01/04/2051           | 540 300   | 0,01             |                   |
| 1 050 000   | 4.250%           | Lowe's Cos Inc 01/04/2052           | 863 268   | 0,01             |                   |
| 1 350 000   | 5.625%           | Lowe's Cos Inc 15/04/2053           | 1 356 885   | 0,02             |                   |
| 555 000   | 5.750%           | Lowe's Cos Inc 01/07/2053           | 566 849   | 0,01             |                   |
| 1 200 000   | 4.450%           | Lowe's Cos Inc 01/04/2062           | 980 280   | 0,01             |                   |
| 300 000   | 5.800%           | Lowe's Cos Inc 15/09/2062           | 301 659   | 0,00             |                   |
| 555 000   | 5.850%           | Lowe's Cos Inc 01/04/2063           | 564 202   | 0,01             |                   |
| 400 000   | 3.625%           | Magna International Inc 15/06/2024  | 392 608   | 0,01             |                   |
| 700 000   | 4.150%           | Magna International Inc 01/10/2025  | 685 741   | 0,01             |                   |
| 1 000 000   | 5.980%           | Magna International Inc 21/03/2026  | 1 009 000   | 0,01             |                   |
| 500 000   | 2.450%           | Magna International Inc 15/06/2030  | 424 425   | 0,01             |                   |
| 1 000 000   | 5.500%           | Magna International Inc 21/03/2033  | 1 039 170   | 0,02             |                   |
| 1 504 000   | 3.625%           | Marathon Petroleum Corp 15/09/2024  | 1 479 064   | 0,02             |                   |
| 3 456 000   | 4.700%           | Marathon Petroleum Corp 01/05/2025  | 3 449 537   | 0,05             |                   |
| 500 000   | 5.125%           | Marathon Petroleum Corp 15/12/2026  | 504 460   | 0,01             |                   |
| 404 000   | 6.500%           | Marathon Petroleum Corp 01/03/2041  | 429 472   | 0,01             |                   |
| 715 000   | 4.750%           | Marathon Petroleum Corp 15/09/2044  | 615 350   | 0,01             |                   |
| 1 500 000   | 4.500%           | Marathon Petroleum Corp 01/04/2048  | 1 229 460   | 0,02             |                   |
| 896 000   | 5.000%           | Marathon Petroleum Corp 15/09/2054  | 771 707   | 0,01             |                   |
| 602 000   | 3.375%           | Mastercard Inc 01/04/2024           | 595 745   | 0,01             |                   |
| 23 000  | 2.000%           | Mastercard Inc 03/03/2025           | 21 998  | 0,00             |                   |
| 436 000   | 2.950%           | Mastercard Inc 21/11/2026           | 417 649   | 0,01             |                   |
| 1 526 000   | 3.300%           | Mastercard Inc 26/03/2027           | 1 478 084   | 0,02             |                   |
| 99 000  | 3.500%           | Mastercard Inc 26/02/2028           | 95 849  | 0,00             |                   |
| 715 000   | 4.875%           | Mastercard Inc 09/03/2028           | 737 844   | 0,01             |                   |
| 1 867 000   | 2.950%           | Mastercard Inc 01/06/2029           | 1 733 846   | 0,03             |                   |
| 2 222 000   | 3.350%           | Mastercard Inc 26/03/2030           | 2 114 988   | 0,03             |                   |
| 1 000 000   | 4.850%           | Mastercard Inc 09/03/2033           | 1 040 790   | 0,02             |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Parti-<br>pation Investissement   | Juste<br>valeur<br>USD | % des<br>actifs<br>nets | Parti-<br>pation Investissement   | Juste<br>valeur<br>USD | % des<br>actifs<br>nets |
|---|------------------------|-------------------------|---|------------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                        |                         | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                        |                         |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                        |                         | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                        |                         |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                        |                         | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                        |                         |
| 645 000 3.800% Mastercard Inc 21/11/2046                                | 562 440                | 0,01                    | 503 000 3.600% MetLife Inc 13/11/2025                                   | 492 759                | 0,01                    |
| 1 021 000 3.950% Mastercard Inc 26/02/2048                              | 920 595                | 0,01                    | 2 489 000 4.550% MetLife Inc 23/03/2030                                 | 2 451 541              | 0,04                    |
| 3 114 000 3.650% Mastercard Inc 01/06/2049                              | 2 661 411              | 0,04                    | 521 000 6.500% MetLife Inc 15/12/2032                                   | 579 800                | 0,01                    |
| 2 584 000 3.850% Mastercard Inc 26/03/2050                              | 2 295 884              | 0,03                    | 260 000 6.375% MetLife Inc 15/06/2034                                   | 289 648                | 0,00                    |
| 50 000 2.500% McCormick & Co Inc/MD 15/04/2030                          | 42 768                 | 0,00                    | 1 597 000 5.700% MetLife Inc 15/06/2035                                 | 1 687 230              | 0,02                    |
| 680 000 4.125% Mead Johnson Nutrition Co 15/11/2025                     | 670 201                | 0,01                    | 2 654 000 5.875% MetLife Inc 06/02/2041                                 | 2 757 294              | 0,04                    |
| 500 000 5.900% Mead Johnson Nutrition Co 01/11/2039                     | 533 580                | 0,01                    | 714 000 4.125% MetLife Inc 13/08/2042                                   | 601 109                | 0,01                    |
| 200 000 4.600% Mead Johnson Nutrition Co 01/06/2044                     | 183 948                | 0,00                    | 2 132 000 4.875% MetLife Inc 13/11/2043                                 | 1 988 644              | 0,03                    |
| 1 625 000 4.250% Medtronic Global Holdings SCA 30/03/2028               | 1 617 571              | 0,02                    | 327 000 4.721% MetLife Inc 15/12/2044                                   | 298 443                | 0,00                    |
| 3 000 000 4.500% Medtronic Global Holdings SCA 30/03/2033               | 2 994 560              | 0,04                    | 1 034 000 4.050% MetLife Inc 01/03/2045                                 | 867 847                | 0,01                    |
| 3 090 000 4.375% Medtronic Inc 15/03/2035                               | 3 044 021              | 0,04                    | 100 000 4.600% MetLife Inc 13/05/2046                                   | 88 976                 | 0,00                    |
| 876 000 4.000% Medtronic Inc 01/04/2043                                 | 786 087                | 0,01                    | 880 000 5.000% MetLife Inc 15/07/2052                                   | 822 527                | 0,01                    |
| 5 302 000 4.625% Medtronic Inc 15/03/2045                               | 5 191 679              | 0,08                    | 2 000 000 5.250% MetLife Inc 15/01/2054                                 | 1 951 840              | 0,03                    |
| 5 022 000 2.750% Merck & Co Inc 10/02/2025                              | 4 913 525              | 0,07                    | 1 754 000 6.400% MetLife Inc 15/12/2066                                 | 1 676 140              | 0,02                    |
| 4 095 000 0.750% Merck & Co Inc 24/02/2026                              | 3 747 130              | 0,05                    | 69 000 4.975% Micron Technology Inc 06/02/2026                          | 68 792                 | 0,00                    |
| 1 500 000 1.700% Merck & Co Inc 10/06/2027                              | 1 363 380              | 0,02                    | 452 000 4.185% Micron Technology Inc 15/02/2027                         | 436 677                | 0,01                    |
| 2 000 000 1.900% Merck & Co Inc 10/12/2028                              | 1 777 980              | 0,03                    | 801 000 5.327% Micron Technology Inc 06/02/2029                         | 804 156                | 0,01                    |
| 3 241 000 3.400% Merck & Co Inc 07/03/2029                              | 3 115 703              | 0,05                    | 1 500 000 6.750% Micron Technology Inc 01/11/2029                       | 1 595 865              | 0,02                    |
| 308 000 1.450% Merck & Co Inc 24/06/2030                                | 254 513                | 0,00                    | 1 052 000 4.663% Micron Technology Inc 15/02/2030                       | 1 009 836              | 0,01                    |
| 3 300 000 2.150% Merck & Co Inc 10/12/2031                              | 2 787 807              | 0,04                    | 935 000 5.875% Micron Technology Inc 09/02/2033                         | 945 556                | 0,01                    |
| 3 000 000 6.550% Merck & Co Inc 15/09/2037                              | 3 582 570              | 0,05                    | 1 130 000 3.366% Micron Technology Inc 01/11/2041                       | 800 436                | 0,01                    |
| 1 482 000 3.900% Merck & Co Inc 07/03/2039                              | 1 358 920              | 0,02                    | 3 410 000 3.477% Micron Technology Inc 01/11/2051                       | 2 223 320              | 0,03                    |
| 6 384 000 2.350% Merck & Co Inc 24/06/2040                              | 4 707 115              | 0,07                    | 2 742 000 2.700% Microsoft Corp 12/02/2025                              | 2 673 587              | 0,04                    |
| 1 141 000 3.600% Merck & Co Inc 15/09/2042                              | 975 772                | 0,01                    | 4 711 000 3.125% Microsoft Corp 03/11/2025                              | 4 595 298              | 0,07                    |
| 4 541 000 4.150% Merck & Co Inc 18/05/2043                              | 4 256 506              | 0,06                    | 6 029 000 2.400% Microsoft Corp 08/08/2026                              | 5 734 001              | 0,08                    |
| 7 259 000 3.700% Merck & Co Inc 10/02/2045                              | 6 324 984              | 0,09                    | 8 252 000 3.300% Microsoft Corp 06/02/2027                              | 8 095 542              | 0,12                    |
| 1 361 000 4.000% Merck & Co Inc 07/03/2049                              | 1 221 851              | 0,02                    | 7 075 000 3.500% Microsoft Corp 12/02/2035                              | 6 713 184              | 0,10                    |
| 950 000 2.450% Merck & Co Inc 24/06/2050                                | 638 980                | 0,01                    | 870 000 4.200% Microsoft Corp 03/11/2035                                | 878 683                | 0,01                    |
| 500 000 2.750% Merck & Co Inc 10/12/2051                                | 353 990                | 0,01                    | 2 483 000 3.450% Microsoft Corp 08/08/2036                              | 2 298 786              | 0,03                    |
| 1 680 000 2.900% Merck & Co Inc 10/12/2061                              | 1 151 472              | 0,02                    | 4 800 000 4.100% Microsoft Corp 06/02/2037                              | 4 758 288              | 0,07                    |
| 50 000 5.950% Merck Sharp & Dohme Corp 01/12/2028                       | 54 327                 | 0,00                    | 1 150 000 5.300% Microsoft Corp 08/02/2041                              | 1 276 581              | 0,02                    |
| 2 105 000 5.750% Merck Sharp & Dohme Corp 15/11/2036                    | 2 313 227              | 0,03                    | 500 000 3.500% Microsoft Corp 15/11/2042                                | 445 400                | 0,01                    |
| 3 200 000 3.500% Meta Platforms Inc 15/08/2027                          | 3 089 120              | 0,05                    | 625 000 3.750% Microsoft Corp 12/02/2045                                | 571 794                | 0,01                    |
| 2 875 000 3.850% Meta Platforms Inc 15/08/2032                          | 2 692 667              | 0,04                    | 1 150 000 4.450% Microsoft Corp 03/11/2045                              | 1 147 999              | 0,02                    |
| 4 100 000 4.450% Meta Platforms Inc 15/08/2052                          | 3 609 353              | 0,05                    | 4 720 000 3.700% Microsoft Corp 08/08/2046                              | 4 280 993              | 0,06                    |
| 2 075 000 4.650% Meta Platforms Inc 15/08/2062                          | 1 836 956              | 0,03                    | 2 260 000 4.250% Microsoft Corp 06/02/2047                              | 2 213 513              | 0,03                    |
| 549 000 3.600% MetLife Inc 10/04/2024                                   | 541 215                | 0,01                    | 6 579 000 2.525% Microsoft Corp 01/06/2050                              | 6 633 392              | 0,07                    |
| 713 000 3.000% MetLife Inc 01/03/2025                                   | 689 906                | 0,01                    | 16 449 000 2.921% Microsoft Corp 17/03/2052                             | 12 464 888             | 0,18                    |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 1 900 000 3.950%  | 1 732 078        | 0,03              | 3 476 000 3.625%  | 3 345 163        | 0,05              |
| 2 130 000 4.500%  | 2 192 047        | 0,03              | 1 600 000 5.050%  | 1 596 992        | 0,02              |
| 4 213 000 2.675%  | 2 909 919        | 0,04              | 6 390 000 3.950%  | 6 172 868        | 0,09              |
| 6 764 000 3.041%  | 5 073 203        | 0,07              | 5 900 000 1.593%  | 5 313 422        | 0,08              |
| 792 000 3.000%  | 747 838          | 0,01              | 3 500 000 1.512%  | 3 105 795        | 0,05              |
| 3 052 000 5.000%  | 2 868 239        | 0,04              | 800 000 2.475%  | 731 464          | 0,01              |
| 4 641 000 4.200%  | 3 800 515        | 0,06              | 1 305 000 4.210%  | 1 267 781        | 0,02              |
| 1 221 000 1.500%  | 1 142 368        | 0,02              | 5 350 000 3.591%  | 5 057 248        | 0,07              |
| 854 000 2.750%  | 757 737          | 0,01              | 1 050 000 6.296%  | 1 104 506        | 0,02              |
| 1 382 000 1.500%  | 1 102 560        | 0,02              | 5 380 000 3.772%  | 5 097 604        | 0,07              |
| 2 570 000 1.875%  | 2 057 326        | 0,03              | 1 050 000 5.123%  | 1 056 573        | 0,02              |
| 1 705 000 2.625%  | 1 143 782        | 0,02              | 7 735 000 4.431%  | 7 444 937        | 0,11              |
| 120 000 3.750%  | 117 572          | 0,00              | 4 264 000 2.699%  | 3 670 963        | 0,05              |
| 164 000 4.250%  | 160 233          | 0,00              | 2 873 000 3.622%  | 2 630 203        | 0,04              |
| 460 000 2.000%  | 376 105          | 0,01              | 1 465 000 1.794%  | 1 150 274        | 0,02              |
| 1 000 000 4.250%  | 963 070          | 0,01              | 628 000 7.250%  | 734 094          | 0,01              |
| 1 350 000 2.750%  | 968 963          | 0,01              | 1 110 000 1.928%  | 877 688          | 0,01              |
| 817 000 5.250%  | 805 488          | 0,01              | 7 000 000 2.239%  | 5 630 730        | 0,08              |
| 546 000 4.875%  | 511 127          | 0,01              | 6 000 000 2.511%  | 4 911 000        | 0,07              |
| 1 500 000 3.100%  | 990 420          | 0,01              | 3 300 000 2.943%  | 2 796 981        | 0,04              |
| 4 721 000 3.875%  | 4 662 082        | 0,07              | 1 600 000 4.889%  | 1 570 480        | 0,02              |
| 3 246 000 3.700%  | 3 188 935        | 0,05              | 3 925 000 6.342%  | 4 291 124        | 0,06              |
| 2 125 000 3.620%  | 2 085 730        | 0,03              | 15 450 000 2.484%   | 11 684 526       | 0,17              |
| 4 200 000 0.790%  | 3 976 476        | 0,06              | 1 880 000 5.297%  | 1 771 975        | 0,03              |
| 4 220 000 2.720%  | 4 070 950        | 0,06              | 2 665 000 5.948%  | 2 644 213        | 0,04              |
| 3 467 000 4.000%  | 3 399 948        | 0,05              | 2 497 000 3.971%  | 2 201 430        | 0,03              |
| 1 500 000 0.864%  | 1 393 875        | 0,02              | 3 000 000 4.457%  | 2 753 010        | 0,04              |
| 2 500 000 1.164%  | 2 335 075        | 0,03              | 1 260 000 3.217%  | 972 896          | 0,01              |
| 17 700 000 5.000%   | 17 613 093       | 0,26              | 4 371 000 6.375%  | 4 907 977        | 0,07              |
| 3 571 000 3.875%  | 3 489 367        | 0,05              | 3 250 000 4.300%  | 2 850 217        | 0,04              |
| 2 900 000 2.630%  | 2 754 246        | 0,04              | 3 829 000 4.375%  | 3 431 243        | 0,05              |
| 6 175 000 2.188%  | 5 802 524        | 0,08              | 2 784 000 5.597%  | 2 942 382        | 0,04              |
| 1 125 000 4.679%  | 1 109 948        | 0,02              | 3 600 000 2.802%  | 2 377 260        | 0,03              |
| 2 298 000 3.125%  | 2 177 608        | 0,03              | 153 000 4.000%  | 150 088          | 0,00              |
| 125 000 6.250%  | 130 551          | 0,00              | 30 000 4.600%   | 29 612           | 0,00              |
| 6 447 000 4.350%  | 6 289 435        | 0,09              | 881 000 4.600%  | 858 667          | 0,01              |
| 2 000 000 6.138%  | 2 046 080        | 0,03              | 1 113 000 2.300%  | 904 290          | 0,01              |
| 1 406 000 0.985%  | 1 253 126        | 0,02              | 2 000 000 2.750%  | 1 644 420        | 0,02              |
|   |                  |                   | 3 000 000 5.600%  | 3 017 280        | 0,04              |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 132 000 5.500% Motorola Solutions Inc 01/09/2044                        | 125 712          | 0,00              | 2 797 000 5.450% Newmont Corp 09/06/2044                                | 2 780 805        | 0,04              |
| 350 000 7.450% Munich Re America Corp 15/12/2026                        | 383 033          | 0,01              | 1 800 000 4.255% NextEra Energy Capital Holdings Inc 01/09/2024         | 1 782 846        | 0,03              |
| 500 000 5.200% Mylan Inc 15/04/2048                                     | 394 105          | 0,01              | 1 000 000 3.550% NextEra Energy Capital Holdings Inc 01/05/2027         | 957 650          | 0,01              |
| 1 645 000 5.132% National Australia Bank Ltd/New York 22/11/2024        | 1 655 791        | 0,02              | 2 341 000 2.250% NextEra Energy Capital Holdings Inc 01/06/2030         | 1 978 754        | 0,03              |
| 1 010 000 3.500% National Australia Bank Ltd/New York 09/06/2025        | 984 134          | 0,01              | 700 000 2.400% NIKE Inc 27/03/2025                                      | 679 476          | 0,01              |
| 1 455 000 4.966% National Australia Bank Ltd/New York 12/01/2026        | 1 467 644        | 0,02              | 4 914 000 2.375% NIKE Inc 01/11/2026                                    | 4 619 799        | 0,07              |
| 2 599 000 3.375% National Australia Bank Ltd/New York 14/01/2026        | 2 509 958        | 0,04              | 1 921 000 2.750% NIKE Inc 27/03/2027                                    | 1 826 564        | 0,03              |
| 4 060 000 2.500% National Australia Bank Ltd/New York 12/07/2026        | 3 791 959        | 0,06              | 3 502 000 2.850% NIKE Inc 27/03/2030                                    | 3 219 984        | 0,05              |
| 1 950 000 3.905% National Australia Bank Ltd/New York 09/06/2027        | 1 893 177        | 0,03              | 8 169 000 3.250% NIKE Inc 27/03/2040                                    | 6 926 168        | 0,10              |
| 2 000 000 4.944% National Australia Bank Ltd/New York 12/01/2028        | 2 027 080        | 0,03              | 3 290 000 3.625% NIKE Inc 01/05/2043                                    | 2 822 458        | 0,04              |
| 475 000 0.750% National Bank of Canada 06/08/2024                       | 447 084          | 0,01              | 12 343 000 3.875% NIKE Inc 01/11/2045                                   | 11 168 440       | 0,16              |
| 2 000 000 5.250% National Bank of Canada 17/01/2025                     | 1 996 860        | 0,03              | 3 660 000 3.375% NIKE Inc 01/11/2046                                    | 2 989 708        | 0,04              |
| 300 000 5.125% NatVest Group PLC 28/05/2024                             | 296 016          | 0,00              | 11 166 000 3.375% NIKE Inc 27/03/2050                                   | 9 212 843        | 0,13              |
| 1 942 000 4.800% NatVest Group PLC 05/04/2026                           | 1 894 207        | 0,03              | 750 000 5.250% NiSource Inc 30/03/2028                                  | 765 210          | 0,01              |
| 2 205 000 7.472% NatVest Group PLC 10/11/2026                           | 2 287 114        | 0,03              | 2 000 000 5.250% NiSource Inc 15/02/2043                                | 1 995 840        | 0,03              |
| 220 000 5.847% NatVest Group PLC 02/03/2027                             | 220 502          | 0,00              | 2 000 000 4.800% NiSource Inc 15/02/2044                                | 1 849 680        | 0,03              |
| 2 470 000 1.642% NatVest Group PLC 14/06/2027                           | 2 176 811        | 0,03              | 700 000 5.650% NiSource Inc 01/02/2045                                  | 727 678          | 0,01              |
| 2 802 000 3.073% NatVest Group PLC 22/05/2028                           | 2 536 090        | 0,04              | 1 050 000 4.375% NiSource Inc 15/05/2047                                | 911 579          | 0,01              |
| 1 380 000 5.516% NatVest Group PLC 30/09/2028                           | 1 368 546        | 0,02              | 1 970 000 2.648% Nomura Holdings Inc 16/01/2025                         | 1 866 339        | 0,03              |
| 2 369 000 4.892% NatVest Group PLC 18/05/2029                           | 2 279 002        | 0,03              | 1 959 000 1.851% Nomura Holdings Inc 16/07/2025                         | 1 794 855        | 0,03              |
| 965 000 3.754% NatVest Group PLC 01/11/2029                             | 904 996          | 0,01              | 1 300 000 5.709% Nomura Holdings Inc 09/01/2026                         | 1 301 495        | 0,02              |
| 1 845 000 5.076% NatVest Group PLC 27/01/2030                           | 1 792 012        | 0,03              | 150 000 1.653% Nomura Holdings Inc 14/07/2026                           | 131 658          | 0,00              |
| 2 096 000 4.445% NatVest Group PLC 08/05/2030                           | 1 963 197        | 0,03              | 1 900 000 2.329% Nomura Holdings Inc 22/01/2027                         | 1 679 524        | 0,02              |
| 300 000 6.016% NatVest Group PLC 02/03/2034                             | 310 389          | 0,00              | 1 450 000 5.386% Nomura Holdings Inc 06/07/2027                         | 1 425 480        | 0,02              |
| 2 300 000 3.032% NatVest Group PLC 28/11/2035                           | 1 755 107        | 0,03              | 1 300 000 5.842% Nomura Holdings Inc 18/01/2028                         | 1 304 784        | 0,02              |
| 3 000 000 5.950% NBCUniversal Media LLC 01/04/2041                      | 3 257 670        | 0,05              | 50 000 2.172% Nomura Holdings Inc 14/07/2028                            | 41 823           | 0,00              |
| 25 000 3.300% NetApp Inc 29/09/2024                                     | 24 322           | 0,00              | 500 000 2.710% Nomura Holdings Inc 22/01/2029                           | 424 120          | 0,01              |
| 2 403 000 1.875% NetApp Inc 22/06/2025                                  | 2 242 768        | 0,03              | 3 399 000 3.103% Nomura Holdings Inc 16/01/2030                         | 2 868 518        | 0,04              |
| 258 000 2.375% NetApp Inc 22/06/2027                                    | 237 504          | 0,00              | 536 000 2.679% Nomura Holdings Inc 16/07/2030                           | 433 361          | 0,01              |
| 3 572 000 2.800% Newmont Corp 01/10/2029                                | 3 167 328        | 0,05              | 3 610 000 2.608% Nomura Holdings Inc 14/07/2031                         | 2 829 771        | 0,04              |
| 3 238 000 2.250% Newmont Corp 01/10/2030                                | 2 718 528        | 0,04              | 1 300 000 6.181% Nomura Holdings Inc 18/01/2033                         | 1 320 111        | 0,02              |
| 2 000 000 2.600% Newmont Corp 15/07/2032                                | 1 671 540        | 0,02              | 644 000 6.250% Northern States Power Co/MN 01/06/2036                   | 715 252          | 0,01              |
| 990 000 5.875% Newmont Corp 01/04/2035                                  | 1 044 599        | 0,02              |   |                  |                   |
| 12 827 000 6.250% Newmont Corp 01/10/2039                               | 14 001 371       | 0,20              |   |                  |                   |
| 16 221 000 4.875% Newmont Corp 15/03/2042                               | 15 514 089       | 0,23              |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets                                 | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|---|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 1 273 000   | 6.200%           | Northern States Power Co/MN 01/07/2037            | 1 409 300   | 0,02             |                   |
| 505 000   | 5.350%           | Northern States Power Co/MN 01/11/2039            | 523 746   | 0,01             |                   |
| 3 849 000   | 3.400%           | Northern States Power Co/MN 15/08/2042            | 3 132 663   | 0,05             |                   |
| 364 000   | 4.125%           | Northern States Power Co/MN 15/05/2044            | 319 563   | 0,00             |                   |
| 2 348 000   | 4.000%           | Northern States Power Co/MN 15/08/2045            | 2 017 237   | 0,03             |                   |
| 502 000   | 3.600%           | Northern States Power Co/MN 15/05/2046            | 398 543   | 0,01             |                   |
| 572 000   | 3.600%           | Northern States Power Co/MN 15/09/2047            | 462 754   | 0,01             |                   |
| 700 000   | 4.500%           | Northern States Power Co/MN 01/06/2052            | 646 373   | 0,01             |                   |
| 200 000   | 4.000%           | Northwest Pipeline LLC 01/04/2027                 | 193 644   | 0,00             |                   |
| 35 024 000  | 3.400%           | Novartis Capital Corp 06/05/2024                  | 34 580 246  | 0,51             |                   |
| 18 340 000  | 1.750%           | Novartis Capital Corp 14/02/2025                  | 17 491 041  | 0,26             |                   |
| 30 888 000  | 3.000%           | Novartis Capital Corp 20/11/2025                  | 29 999 043  | 0,44             |                   |
| 23 586 000  | 2.000%           | Novartis Capital Corp 14/02/2027                  | 21 776 010  | 0,32             |                   |
| 14 617 000  | 3.100%           | Novartis Capital Corp 17/05/2027                  | 14 059 361  | 0,21             |                   |
| 22 200 000  | 2.200%           | Novartis Capital Corp 14/08/2030                  | 19 476 282  | 0,28             |                   |
| 2 575 000   | 3.700%           | Novartis Capital Corp 21/09/2042                  | 2 291 621   | 0,03             |                   |
| 5 171 000   | 4.400%           | Novartis Capital Corp 06/05/2044                  | 5 092 970   | 0,07             |                   |
| 2 318 000   | 4.000%           | Novartis Capital Corp 20/11/2045                  | 2 133 139   | 0,03             |                   |
| 2 773 000   | 2.750%           | Novartis Capital Corp 14/08/2050                  | 2 052 214   | 0,03             |                   |
| 48 000  | 3.200%           | NSTAR Electric Co 15/05/2027                      | 45 623  | 0,00             |                   |
| 23 000  | 3.250%           | NSTAR Electric Co 15/05/2029                      | 21 410  | 0,00             |                   |
| 5 000   | 3.950%           | NSTAR Electric Co 01/04/2030                      | 4 842   | 0,00             |                   |
| 379 000   | 5.500%           | NSTAR Electric Co 15/03/2040                      | 396 726   | 0,01             |                   |
| 1 425 000   | 4.950%           | NSTAR Electric Co 15/09/2052                      | 1 413 386   | 0,02             |                   |
| 335 000   | 5.900%           | Nutrien Ltd 07/11/2024                            | 339 811   | 0,01             |                   |
| 355 000   | 5.950%           | Nutrien Ltd 07/11/2025                            | 365 213   | 0,01             |                   |
| 320 000   | 4.000%           | Nutrien Ltd 15/12/2026                            | 309 811   | 0,00             |                   |
| 465 000   | 4.900%           | Nutrien Ltd 27/03/2028                            | 465 465   | 0,01             |                   |
| 2 110 000   | 4.200%           | Nutrien Ltd 01/04/2029                            | 2 036 741   | 0,03             |                   |
| 3 000 000   | 2.950%           | Nutrien Ltd 13/05/2030                            | 2 637 480   | 0,04             |                   |
| 550 000   | 4.125%           | Nutrien Ltd 15/03/2035                            | 493 345   | 0,01             |                   |
| 350 000   | 5.875%           | Nutrien Ltd 01/12/2036                            | 365 355   | 0,01             |                   |
| 480 000   | 6.125%           | Nutrien Ltd 15/01/2041                            | 503 107   | 0,01             |                   |
| 570 000   | 4.900%           | Nutrien Ltd 01/06/2043                            | 525 187   | 0,01             |                   |
| 700 000   | 5.250%           | Nutrien Ltd 15/01/2045                            | 668 143   | 0,01             |                   |
| 535 000   | 5.800%           | Nutrien Ltd 27/03/2053                            | 552 511   | 0,01             |                   |
| 570 000   | 0.584%           | NVIDIA Corp 14/06/2024                            | 544 361   | 0,01             |                   |
| 1 181 000   | 3.200%           | NVIDIA Corp 16/09/2026                            | 1 148 511   | 0,02             |                   |
| 2 750 000   | 1.550%           | NVIDIA Corp 15/06/2028                            | 2 423 822   | 0,04             |                   |
| 1 294 000   | 2.850%           | NVIDIA Corp 01/04/2030                            | 1 177 799   | 0,02             |                   |
| 500 000   | 2.000%           | NVIDIA Corp 15/06/2031                            | 419 920   | 0,01             |                   |
| 3 542 000   | 3.500%           | NVIDIA Corp 01/04/2040                            | 3 037 619   | 0,04             |                   |
| 1 606 000   | 3.500%           | NVIDIA Corp 01/04/2050                            | 1 315 539   | 0,02             |                   |
| 632 000   | 3.700%           | NVIDIA Corp 01/04/2060                            | 506 605   | 0,01             |                   |
| 45 000  | 5.350%           | NXP BV / NXP Funding LLC 01/03/2026               | 45 158  | 0,00             |                   |
| 1 474 000   | 5.550%           | NXP BV / NXP Funding LLC 01/12/2028               | 1 506 163   | 0,02             |                   |
| 468 000   | 2.700%           | NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 01/05/2025 | 443 865   | 0,01             |                   |
| 561 000   | 3.875%           | NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 18/06/2026 | 541 382   | 0,01             |                   |
| 1 109 000   | 3.150%           | NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 01/05/2027 | 1 028 254   | 0,02             |                   |
| 615 000   | 4.400%           | NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 01/06/2027 | 607 682   | 0,01             |                   |
| 1 256 000   | 4.300%           | NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 18/06/2029 | 1 204 253   | 0,02             |                   |
| 760 000   | 3.400%           | NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 01/05/2030 | 683 278   | 0,01             |                   |
| 800 000   | 5.000%           | NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 15/01/2033 | 783 656   | 0,01             |                   |
| 2 040 000   | 3.250%           | NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 11/05/2041 | 1 482 856   | 0,02             |                   |
| 1 000 000   | 3.125%           | NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 15/02/2042 | 711 290   | 0,01             |                   |
| 575 000   | 3.250%           | NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc 30/11/2051 | 384 238   | 0,01             |                   |
| 450 000   | 2.600%           | Ohio Power Co 01/04/2030                          | 391 406   | 0,01             |                   |
| 352 000   | 1.625%           | Ohio Power Co 15/01/2031                          | 280 389   | 0,00             |                   |
| 300 000   | 4.000%           | Ohio Power Co 01/06/2049                          | 250 314   | 0,00             |                   |
| 800 000   | 2.900%           | Ohio Power Co 01/10/2051                          | 544 144   | 0,01             |                   |
| 3 300 000   | 2.750%           | Oncor Electric Delivery Co LLC 01/06/2024         | 3 220 305   | 0,05             |                   |
| 500 000   | 0.550%           | Oncor Electric Delivery Co LLC 01/10/2025         | 450 885   | 0,01             |                   |
| 1 402 000   | 3.700%           | Oncor Electric Delivery Co LLC 15/11/2028         | 1 359 730   | 0,02             |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 561 000 5.750% Oncor Electric Delivery Co LLC 15/03/2029                | 594 896          | 0,01              | 2 065 000 6.500% Oracle Corp 15/04/2038                                 | 2 238 088        | 0,03              |
| 750 000 4.150% Oncor Electric Delivery Co LLC 01/06/2032                | 725 925          | 0,01              | 3 595 000 6.125% Oracle Corp 08/07/2039                                 | 3 747 428        | 0,05              |
| 95 000 7.250% Oncor Electric Delivery Co LLC 15/01/2033                 | 113 634          | 0,00              | 3 249 000 3.600% Oracle Corp 01/04/2040                                 | 2 517 618        | 0,04              |
| 200 000 7.500% Oncor Electric Delivery Co LLC 01/09/2038                | 249 432          | 0,00              | 5 326 000 5.375% Oracle Corp 15/07/2040                                 | 5 098 740        | 0,07              |
| 280 000 5.250% Oncor Electric Delivery Co LLC 30/09/2040                | 282 789          | 0,00              | 3 900 000 3.650% Oracle Corp 25/03/2041                                 | 3 020 238        | 0,04              |
| 905 000 4.550% Oncor Electric Delivery Co LLC 01/12/2041                | 857 352          | 0,01              | 3 281 000 4.500% Oracle Corp 08/07/2044                                 | 2 743 178        | 0,04              |
| 990 000 5.300% Oncor Electric Delivery Co LLC 01/06/2042                | 1 025 709        | 0,02              | 3 894 000 4.125% Oracle Corp 15/05/2045                                 | 3 064 383        | 0,04              |
| 900 000 3.750% Oncor Electric Delivery Co LLC 01/04/2045                | 755 442          | 0,01              | 5 007 000 4.000% Oracle Corp 15/07/2046                                 | 3 830 255        | 0,06              |
| 2 545 000 4.100% Oncor Electric Delivery Co LLC 15/11/2048              | 2 229 802        | 0,03              | 2 983 000 4.000% Oracle Corp 15/11/2047                                 | 2 276 834        | 0,03              |
| 300 000 3.800% Oncor Electric Delivery Co LLC 01/06/2049                | 249 435          | 0,00              | 4 590 000 3.600% Oracle Corp 01/04/2050                                 | 3 251 051        | 0,05              |
| 4 496 000 3.100% Oncor Electric Delivery Co LLC 15/09/2049              | 3 285 767        | 0,05              | 1 965 000 3.950% Oracle Corp 25/03/2051                                 | 1 476 187        | 0,02              |
| 1 425 000 4.600% Oncor Electric Delivery Co LLC 01/06/2052              | 1 323 084        | 0,02              | 1 675 000 6.900% Oracle Corp 09/11/2052                                 | 1 877 558        | 0,03              |
| 500 000 4.950% Oncor Electric Delivery Co LLC 15/09/2052                | 495 090          | 0,01              | 1 080 000 5.550% Oracle Corp 06/02/2053                                 | 1 027 922        | 0,02              |
| 4 065 000 3.400% Oracle Corp 08/07/2024                                 | 3 982 968        | 0,06              | 1 753 000 4.375% Oracle Corp 15/05/2055                                 | 1 385 080        | 0,02              |
| 1 795 000 2.950% Oracle Corp 15/11/2024                                 | 1 744 076        | 0,03              | 4 450 000 3.850% Oracle Corp 01/04/2060                                 | 3 104 676        | 0,05              |
| 5 215 000 2.500% Oracle Corp 01/04/2025                                 | 4 989 034        | 0,07              | 675 000 4.100% Oracle Corp 25/03/2061                                   | 495 329          | 0,01              |
| 2 998 000 2.950% Oracle Corp 15/05/2025                                 | 2 886 834        | 0,04              | 4 691 000 9.000% Orange SA 01/03/2031                                   | 5 897 807        | 0,09              |
| 285 000 5.800% Oracle Corp 10/11/2025                                   | 292 116          | 0,00              | 1 281 000 5.375% Orange SA 13/01/2042                                   | 1 309 746        | 0,02              |
| 1 325 000 1.650% Oracle Corp 25/03/2026                                 | 1 217 370        | 0,02              | 320 000 5.500% Orange SA 06/02/2044                                     | 337 107          | 0,01              |
| 2 969 000 2.650% Oracle Corp 15/07/2026                                 | 2 774 055        | 0,04              | 6 404 000 4.200% Owens Corning 01/12/2024                               | 6 319 531        | 0,09              |
| 1 393 000 2.800% Oracle Corp 01/04/2027                                 | 1 294 752        | 0,02              | 7 660 000 3.400% Owens Corning 15/08/2026                               | 7 293 163        | 0,11              |
| 1 942 000 3.250% Oracle Corp 15/11/2027                                 | 1 826 742        | 0,03              | 7 605 000 3.950% Owens Corning 15/08/2029                               | 7 168 017        | 0,10              |
| 895 000 2.300% Oracle Corp 25/03/2028                                   | 800 944          | 0,01              | 6 450 000 3.875% Owens Corning 01/06/2030                               | 5 962 767        | 0,09              |
| 725 000 4.500% Oracle Corp 06/05/2028                                   | 716 467          | 0,01              | 363 000 7.000% Owens Corning 01/12/2036                                 | 405 184          | 0,01              |
| 690 000 6.150% Oracle Corp 09/11/2029                                   | 735 071          | 0,01              | 17 250 000 4.300% Owens Corning 15/07/2047                              | 14 231 077       | 0,21              |
| 3 890 000 2.950% Oracle Corp 01/04/2030                                 | 3 434 286        | 0,05              | 7 062 000 4.400% Owens Corning 30/01/2048                               | 5 907 010        | 0,09              |
| 151 000 3.250% Oracle Corp 15/05/2030                                   | 135 353          | 0,00              | 259 000 3.650% Packaging Corp of America 15/09/2024                     | 254 641          | 0,00              |
| 2 190 000 2.875% Oracle Corp 25/03/2031                                 | 1 874 071        | 0,03              | 428 000 3.400% Packaging Corp of America 15/12/2027                     | 406 942          | 0,01              |
| 1 100 000 6.250% Oracle Corp 09/11/2032                                 | 1 180 718        | 0,02              | 554 000 3.000% Packaging Corp of America 15/12/2029                     | 498 162          | 0,01              |
| 525 000 4.900% Oracle Corp 06/02/2033                                   | 514 122          | 0,01              | 549 000 4.050% Packaging Corp of America 15/12/2049                     | 450 026          | 0,01              |
| 2 237 000 4.300% Oracle Corp 08/07/2034                                 | 2 044 215        | 0,03              | 1 500 000 1.650% PayPal Holdings Inc 01/06/2025                         | 1 407 750        | 0,02              |
| 3 348 000 3.900% Oracle Corp 15/05/2035                                 | 2 925 435        | 0,04              | 500 000 3.900% PayPal Holdings Inc 01/06/2027                           | 491 695          | 0,01              |
| 1 704 000 3.850% Oracle Corp 15/07/2036                                 | 1 448 775        | 0,02              | 1 500 000 2.300% PayPal Holdings Inc 01/06/2030                         | 1 285 965        | 0,02              |
| 3 770 000 3.800% Oracle Corp 15/11/2037                                 | 3 135 735        | 0,05              | 1 500 000 4.400% PayPal Holdings Inc 01/06/2032                         | 1 471 215        | 0,02              |
|   |                  |                   | 700 000 3.250% PayPal Holdings Inc 01/06/2050                           | 511 728          | 0,01              |
|   |                  |                   | 2 000 000 5.250% PayPal Holdings Inc 01/06/2062                         | 1 935 320        | 0,03              |
|   |                  |                   | 307 000 3.700% PECO Energy Co 15/09/2047                                | 249 508          | 0,00              |
|   |                  |                   | 3 500 000 3.900% PECO Energy Co 01/03/2048                              | 2 966 775        | 0,04              |
|   |                  |                   | 51 000 3.000% PECO Energy Co 15/09/2049                                 | 36 353           | 0,00              |
|   |                  |                   | 43 000 2.800% PECO Energy Co 15/06/2050                                 | 29 245           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 300 000 3.050%  | 212 562          | 0,00              | 3 503 000 7.200%  | 4 412 729        | 0,06              |
| 600 000 2.850%  | 410 256          | 0,01              | 2 345 000 2.550%  | 1 760 579        | 0,03              |
| 1 665 000 4.600%  | 1 555 859        | 0,02              | 590 000 5.600%  | 635 760          | 0,01              |
| 1 165 000 4.375%  | 1 057 459        | 0,02              | 181 000 4.300%  | 170 413          | 0,00              |
| 2 605 000 2.250%  | 2 513 929        | 0,04              | 235 000 4.400%  | 226 009          | 0,00              |
| 311 000 2.750%  | 301 291          | 0,00              | 2 408 000 4.125%  | 2 213 000        | 0,03              |
| 645 000 4.550%  | 656 816          | 0,01              | 2 537 000 4.200%  | 2 357 736        | 0,03              |
| 489 000 2.850%  | 473 176          | 0,01              | 1 486 000 4.000%  | 1 346 896        | 0,02              |
| 115 000 2.375%  | 108 550          | 0,00              | 4 000 2.700%  | 2 868            | 0,00              |
| 480 000 2.625%  | 453 816          | 0,01              | 110 000 6.600%  | 122 913          | 0,00              |
| 3 433 000 3.000%  | 3 286 342        | 0,05              | 2 000 000 4.875%  | 1 860 880        | 0,03              |
| 1 000 000 4.450%  | 1 019 790        | 0,02              | 1 000 000 3.300%  | 705 400          | 0,01              |
| 200 000 7.000%  | 232 784          | 0,00              | 1 200 000 3.750%  | 1 138 642        | 0,02              |
| 652 000 2.625%  | 598 523          | 0,01              | 1 500 000 3.150%  | 1 351 275        | 0,02              |
| 7 806 000 2.750%  | 7 128 127        | 0,10              | 50 000 2.750%   | 34 507           | 0,00              |
| 250 000 1.625%  | 211 400          | 0,00              | Partnership LP 01/04/2032   |                  |                   |
| 258 000 1.400%  | 212 571          | 0,00              | 2 421 000 1.300%  | 2 224 681        | 0,03              |
| 4 000 000 1.950%  | 3 372 240        | 0,05              | 15/06/2025  |                  |                   |
| 800 000 3.900%  | 782 032          | 0,01              | 1 581 000 4.150%  | 1 389 588        | 0,02              |
| 1 250 000 4.450%  | 1 281 550        | 0,02              | 15/03/2043  |                  |                   |
| 160 000 5.500%  | 175 971          | 0,00              | 1 000 000 2.400%  | 963 640          | 0,01              |
| 4 877 000 4.000%  | 4 507 762        | 0,07              | 1 000 000 1.200%  | 901 840          | 0,01              |
| 2 000 000 3.600%  | 1 752 820        | 0,03              | 516 000 3.750%  | 495 876          | 0,01              |
| 98 000 4.250%   | 91 353           | 0,00              | 1 000 000 2.800%  | 887 860          | 0,01              |
| 2 229 000 3.450%  | 1 906 597        | 0,03              | 890 000 0.550%  | 815 970          | 0,01              |
| 3 400 000 4.000%  | 3 211 232        | 0,05              | 29/10/2025  |                  |                   |
| 4 145 000 3.375%  | 3 438 277        | 0,05              | 500 000 4.100%  | 503 725          | 0,01              |
| 1 040 000 2.875%  | 792 438          | 0,01              | 26/01/2026  |                  |                   |
| 1 150 000 3.625%  | 998 338          | 0,01              | 325 000 2.700%  | 314 652          | 0,00              |
| 570 000 4.200%  | 542 697          | 0,01              | 02/02/2026  |                  |                   |
| 1 000 000 4.650%  | 1 024 570        | 0,02              | 1 325 000 1.000%  | 1 210 851        | 0,02              |
| 559 000 3.400%  | 551 275          | 0,01              | 23/04/2026  |                  |                   |
| 470 000 0.800%  | 436 865          | 0,01              | 634 000 2.450%  | 600 861          | 0,01              |
| 1 021 000 2.750%  | 979 343          | 0,01              | 03/11/2026  |                  |                   |
| 2 523 000 3.000%  | 2 430 658        | 0,04              | 1 000 000 1.900%  | 929 970          | 0,01              |
| 280 000 3.600%  | 274 411          | 0,00              | 01/02/2027  |                  |                   |
| 1 311 000 3.450%  | 1 265 902        | 0,02              | 3 960 000 2.800%  | 3 777 721        | 0,06              |
| 3 538 000 2.625%  | 3 191 594        | 0,05              | 25/03/2027  |                  |                   |
| 569 000 1.700%  | 478 899          | 0,01              | 646 000 2.850%  | 617 059          | 0,01              |
| 500 000 1.750%  | 412 240          | 0,01              | 11/08/2027  |                  |                   |
| 2 153 000 4.000%  | 2 070 497        | 0,03              | 550 000 3.950%  | 552 442          | 0,01              |
| 194 000 4.100%  | 182 137          | 0,00              | 26/01/2028  |                  |                   |
| 196 000 3.900%  | 177 680          | 0,00              | 1 044 000 3.000%  | 978 228          | 0,01              |
|   |                  |                   | 25/03/2030  |                  |                   |
|   |                  |                   | 1 354 000 1.200%  | 1 107 328        | 0,02              |
|   |                  |                   | 29/10/2030  |                  |                   |
|   |                  |                   | 500 000 1.950%  | 432 480          | 0,01              |
|   |                  |                   | 23/04/2031  |                  |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 800 000 2.300% Procter & Gamble Co 01/02/2032                           | 708 056          | 0,01              | 2 000 000 5.250% Public Service Co of Oklahoma 15/01/2033               | 2 044 800        | 0,03              |
| 1 000 000 4.050% Procter & Gamble Co 26/01/2033                         | 1 005 800        | 0,01              | 1 100 000 0.950% Public Service Electric and Gas Co 15/03/2026          | 998 184          | 0,01              |
| 620 000 3.550% Procter & Gamble Co 25/03/2040                           | 554 813          | 0,01              | 1 000 000 2.250% Public Service Electric and Gas Co 15/09/2026          | 921 780          | 0,01              |
| 782 000 3.500% Procter & Gamble Co 25/10/2047                           | 671 120          | 0,01              | 853 000 3.650% Public Service Electric and Gas Co 01/09/2028            | 814 538          | 0,01              |
| 465 000 3.600% Procter & Gamble Co 25/03/2050                           | 403 908          | 0,01              | 50 000 2.450% Public Service Electric and Gas Co 15/01/2030             | 43 962           | 0,00              |
| 632 000 3.250% Prologis LP 01/10/2026                                   | 611 340          | 0,01              | 500 000 4.900% Public Service Electric and Gas Co 15/12/2032            | 511 485          | 0,01              |
| 590 000 2.125% Prologis LP 15/04/2027                                   | 538 115          | 0,01              | 600 000 4.650% Public Service Electric and Gas Co 15/03/2033            | 603 306          | 0,01              |
| 500 000 3.875% Prologis LP 15/09/2028                                   | 483 815          | 0,01              | 266 000 5.800% Public Service Electric and Gas Co 01/05/2037            | 287 799          | 0,00              |
| 1 000 000 4.375% Prologis LP 01/02/2029                                 | 983 200          | 0,01              | 500 000 5.500% Public Service Electric and Gas Co 01/03/2040            | 523 715          | 0,01              |
| 350 000 2.250% Prologis LP 15/04/2030                                   | 297 413          | 0,00              | 426 000 3.650% Public Service Electric and Gas Co 01/09/2042            | 351 177          | 0,01              |
| 1 094 000 1.250% Prologis LP 15/10/2030                                 | 857 346          | 0,01              | 325 000 3.800% Public Service Electric and Gas Co 01/01/2043            | 279 364          | 0,00              |
| 2 000 000 4.625% Prologis LP 15/01/2033                                 | 1 966 600        | 0,03              | 1 190 000 3.800% Public Service Electric and Gas Co 01/03/2046          | 980 251          | 0,01              |
| 1 000 000 4.750% Prologis LP 15/06/2033                                 | 994 900          | 0,01              | 2 010 000 3.600% Public Service Electric and Gas Co 01/12/2047          | 1 607 759        | 0,02              |
| 560 000 4.375% Prologis LP 15/09/2048                                   | 490 566          | 0,01              | 500 000 4.050% Public Service Electric and Gas Co 01/05/2048            | 436 505          | 0,01              |
| 50 000 3.050% Prologis LP 01/03/2050                                    | 34 638           | 0,00              | 903 000 3.850% Public Service Electric and Gas Co 01/05/2049            | 759 269          | 0,01              |
| 2 146 000 3.000% Prologis LP 15/04/2050                                 | 1 482 221        | 0,02              | 220 000 3.150% Public Service Electric and Gas Co 01/01/2050            | 163 882          | 0,00              |
| 890 000 2.125% Prologis LP 15/10/2050                                   | 504 016          | 0,01              | 395 000 2.050% Public Service Electric and Gas Co 01/08/2050            | 232 939          | 0,00              |
| 1 000 000 5.250% Prologis LP 15/06/2053                                 | 1 003 010        | 0,01              | 300 000 3.000% Public Service Electric and Gas Co 01/03/2051            | 215 292          | 0,00              |
| 1 500 000 2.250% PROLOGIS LP 15/01/2032                                 | 1 232 235        | 0,02              | 480 000 5.125% Public Service Electric and Gas Co 15/03/2053            | 492 955          | 0,01              |
| 400 000 1.900% Public Service Co of Colorado 15/01/2031                 | 330 532          | 0,00              | 1 468 000 2.875% Public Service Enterprise Group Inc 15/06/2024         | 1 427 571        | 0,02              |
| 2 500 000 1.875% Public Service Co of Colorado 15/06/2031               | 2 042 050        | 0,03              | 717 000 0.800% Public Service Enterprise Group Inc 15/08/2025           | 655 840          | 0,01              |
| 325 000 4.100% Public Service Co of Colorado 01/06/2032                 | 313 040          | 0,00              | 2 000 000 5.850% Public Service Enterprise Group Inc 15/11/2027         | 2 079 360        | 0,03              |
| 470 000 6.250% Public Service Co of Colorado 01/09/2037                 | 530 010          | 0,01              | 4 050 000 1.600% Public Service Enterprise Group Inc 15/08/2030         | 3 240 364        | 0,05              |
| 1 400 000 6.500% Public Service Co of Colorado 01/08/2038               | 1 609 398        | 0,02              | 1 000 000 2.450% Public Service Enterprise Group Inc 15/11/2031         | 828 220          | 0,01              |
| 1 905 000 3.600% Public Service Co of Colorado 15/09/2042               | 1 563 967        | 0,02              | 1 096 000 2.900% QUALCOMM Inc 20/05/2024                                | 1 076 140        | 0,02              |
| 635 000 4.050% Public Service Co of Colorado 15/09/2049                 | 536 156          | 0,01              | 1 500 000 3.450% QUALCOMM Inc 20/05/2025                                | 1 471 635        | 0,02              |
| 750 000 4.500% Public Service Co of Colorado 01/06/2052                 | 692 865          | 0,01              | 1 372 000 3.250% QUALCOMM Inc 20/05/2027                                | 1 327 204        | 0,02              |
| 1 910 000 5.250% Public Service Co of Colorado 01/04/2053               | 1 944 195        | 0,03              |   |                  |                   |
| 875 000 2.200% Public Service Co of New Hampshire 15/06/2031            | 738 579          | 0,01              |   |                  |                   |
| 51 000 3.600% Public Service Co of New Hampshire 01/07/2049             | 40 740           | 0,00              |   |                  |                   |
| 1 000 000 5.150% Public Service Co of New Hampshire 15/01/2053          | 1 015 450        | 0,01              |   |                  |                   |



## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets                     | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets                       |
|---|------------------|---------------------------------------|---|------------------|---|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                                       | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                                       | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                                       | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |   |
| 1 618 000   | 1.300%           | QUALCOMM Inc 20/05/2028               | 725 000   | 0.650%           | Royal Bank of Canada 29/07/2024         |
| 2 125 000   | 2.150%           | QUALCOMM Inc 20/05/2030               | 684 792   | 0,01             |   |
| 2 000 000   | 1.650%           | QUALCOMM Inc 20/05/2032               | 1 050 000   | 5.660%           | Royal Bank of Canada 25/10/2024         |
| 545 000   | 4.250%           | QUALCOMM Inc 20/05/2032               | 1 059 062   | 0,02             |   |
| 1 000 000   | 5.400%           | QUALCOMM Inc 20/05/2033               | 3 416 000   | 2.250%           | Royal Bank of Canada 01/11/2024         |
| 1 189 000   | 4.650%           | QUALCOMM Inc 20/05/2035               | 3 271 162   | 0,05             |   |
| 3 545 000   | 4.800%           | QUALCOMM Inc 20/05/2045               | 1 500 000   | 3.375%           | Royal Bank of Canada 14/04/2025         |
| 700 000   | 4.300%           | QUALCOMM Inc 20/05/2047               | 1 680 000   | 1.150%           | Royal Bank of Canada 10/06/2025         |
| 20 000  | 3.250%           | QUALCOMM Inc 20/05/2050               | 1 546 070   | 0,02             |   |
| 935 000   | 4.500%           | QUALCOMM Inc 20/05/2052               | 1 000 000   | 4.875%           | Royal Bank of Canada 12/01/2026         |
| 1 000 000   | 6.000%           | QUALCOMM Inc 20/05/2053               | 1 001 920   | 0,01             |   |
| 136 000   | 3.600%           | Regency Centers LP 01/02/2027         | 183 000   | 4.650%           | Royal Bank of Canada 27/01/2026         |
| 300 000   | 4.125%           | Regency Centers LP 15/03/2028         | 3 000 000   | 1.200%           | Royal Bank of Canada 27/04/2026         |
| 1 845 000   | 3.700%           | Regency Centers LP 15/06/2030         | 2 770 000   | 1.150%           | Royal Bank of Canada 14/07/2026         |
| 1 000 000   | 4.400%           | Regency Centers LP 01/02/2047         | 5 500 000   | 1.400%           | Royal Bank of Canada 02/11/2026         |
| 360 000   | 4.650%           | Regency Centers LP 15/03/2049         | 1 500 000   | 3.625%           | Royal Bank of Canada 04/05/2027         |
| 1 000 000   | 6.450%           | Regions Bank/Birmingham AL 26/06/2037 | 3 000 000   | 6.000%           | Royal Bank of Canada 01/11/2027         |
| 1 853 000   | 4.000%           | RELX Capital Inc 18/03/2029           | 1 000 000   | 4.900%           | Royal Bank of Canada 12/01/2028         |
| 376 000   | 3.000%           | RELX Capital Inc 22/05/2030           | 1 500 000   | 3.875%           | Royal Bank of Canada 04/05/2032         |
| 1 665 000   | 4.750%           | RELX Capital Inc 20/05/2032           | 1 397 430   | 0,02             |   |
| 700 000   | 7.250%           | Rio Tinto Alcan Inc 15/03/2031        | 1 000 000   | 5.000%           | Royal Bank of Canada 01/02/2033         |
| 895 000   | 6.125%           | Rio Tinto Alcan Inc 15/12/2033        | 1 011 820   | 0,01             |   |
| 3 000 000   | 5.750%           | Rio Tinto Alcan Inc 01/06/2035        | 11 998 000  | 2.950%           | S&P Global Inc 22/01/2027               |
| 1 600 000   | 5.000%           | RIO TINTO FIN USA PLC 09/03/2033      | 1 500 000   | 4.250%           | S&P Global Inc 01/05/2029               |
| 1 703 000   | 7.125%           | Rio Tinto Finance USA Ltd 15/07/2028  | 9 934 000   | 2.500%           | S&P Global Inc 01/12/2029               |
| 3 711 000   | 5.200%           | Rio Tinto Finance USA Ltd 02/11/2040  | 7 800 000   | 1.250%           | S&P Global Inc 15/08/2030               |
| 2 360 000   | 2.750%           | Rio Tinto Finance USA Ltd 02/11/2051  | 2 000 000   | 2.900%           | S&P Global Inc 01/03/2032               |
| 7 760 000   | 4.750%           | Rio Tinto Finance USA PLC 22/03/2042  | 9 752 000   | 3.250%           | S&P Global Inc 01/12/2049               |
| 5 134 000   | 4.125%           | Rio Tinto Finance USA PLC 21/08/2042  | 50 000  | 3.700%           | S&P Global Inc 01/03/2052               |
| 1 500 000   | 5.125%           | Rio Tinto Finance USA PLC 09/03/2053  | 7 596 000   | 2.300%           | S&P Global Inc 15/08/2060               |
| 3 747 000   | 2.550%           | Royal Bank of Canada 16/07/2024       | 2 000 000   | 5.750%           | Sabine Pass Liquefaction LLC 15/05/2024 |
| 1 000 000   | 3.970%           | Royal Bank of Canada 26/07/2024       | 4 000 000   | 5.625%           | Sabine Pass Liquefaction LLC 01/03/2025 |
|   |                  |                                       | 4 000 000   | 4.500%           | Sabine Pass Liquefaction LLC 15/05/2030 |
|   |                  |                                       | 3 864 160   | 0,06             |   |
|   |                  |                                       | 2 850 000   | 0.625%           | Salesforce Inc 15/07/2024               |
|   |                  |                                       | 2 708 469   | 0,04             |   |
|   |                  |                                       | 25 144 000  | 3.700%           | Salesforce Inc 11/04/2028               |
|   |                  |                                       | 24 695 934  | 0,36             |   |
|   |                  |                                       | 12 000 000  | 1.500%           | Salesforce Inc 15/07/2028               |
|   |                  |                                       | 10 592 400  | 0,16             |   |
|   |                  |                                       | 3 000 000   | 1.950%           | Salesforce Inc 15/07/2031               |
|   |                  |                                       | 2 510 640   | 0,04             |   |
|   |                  |                                       | 2 850 000   | 2.700%           | Salesforce Inc 15/07/2041               |
|   |                  |                                       | 2 137 671   | 0,03             |   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 7 500 000 2.900% Salesforce Inc 15/07/2051                              | 5 324 700        | 0,08              | 4 320 000 3.250% Sempra Energy 15/06/2027                               | 4 049 741        | 0,06              |
| 20 000 000 3.050% Salesforce Inc 15/07/2061                             | 13 714 600       | 0,20              | 3 502 000 3.400% Sempra Energy 01/02/2028                               | 3 296 433        | 0,05              |
| 46 000 2.500% San Diego Gas & Electric Co 15/05/2026                    | 43 118           | 0,00              | 1 925 000 3.700% Sempra Energy 01/04/2029                               | 1 788 710        | 0,03              |
| 2 324 000 1.700% San Diego Gas & Electric Co 01/10/2030                 | 1 897 964        | 0,03              | 2 658 000 3.800% Sempra Energy 01/02/2038                               | 2 292 924        | 0,03              |
| 2 000 000 4.500% San Diego Gas & Electric Co 15/08/2040                 | 1 861 640        | 0,03              | 3 428 000 6.000% Sempra Energy 15/10/2039                               | 3 606 599        | 0,05              |
| 3 809 000 3.750% San Diego Gas & Electric Co 01/06/2047                 | 3 101 021        | 0,05              | 9 388 000 4.000% Sempra Energy 01/02/2048                               | 7 649 530        | 0,11              |
| 5 029 000 4.150% San Diego Gas & Electric Co 15/05/2048                 | 4 374 325        | 0,06              | 1 200 000 4.125% Sempra Energy 01/04/2052                               | 960 816          | 0,01              |
| 780 000 4.100% San Diego Gas & Electric Co 15/06/2049                   | 661 994          | 0,01              | 1 800 000 2.000% Shell International Finance BV 07/11/2024              | 1 730 376        | 0,03              |
| 100 000 3.320% San Diego Gas & Electric Co 15/04/2050                   | 74 101           | 0,00              | 1 900 000 3.250% Shell International Finance BV 11/05/2025              | 1 857 250        | 0,03              |
| 1 450 000 5.350% San Diego Gas & Electric Co 01/04/2053                 | 1 498 285        | 0,02              | 2 100 000 2.875% Shell International Finance BV 10/05/2026              | 2 011 632        | 0,03              |
| 16 337 000 3.625% Sanofi 19/06/2028                                     | 15 964 026       | 0,23              | 200 000 2.500% Shell International Finance BV 12/09/2026                | 188 498          | 0,00              |
| 175 000 3.500% Santander Holdings USA Inc 07/06/2024                    | 170 140          | 0,00              | 2 050 000 2.375% Shell International Finance BV 07/11/2029              | 1 819 211        | 0,03              |
| 2 116 000 3.450% Santander Holdings USA Inc 02/06/2025                  | 1 989 188        | 0,03              | 5 156 000 2.750% Shell International Finance BV 06/04/2030              | 4 703 716        | 0,07              |
| 1 465 000 4.260% Santander Holdings USA Inc 09/06/2025                  | 1 413 813        | 0,02              | 2 550 000 4.125% Shell International Finance BV 11/05/2035              | 2 446 572        | 0,04              |
| 2 799 000 4.500% Santander Holdings USA Inc 17/07/2025                  | 2 673 465        | 0,04              | 3 000 000 6.375% Shell International Finance BV 15/12/2038              | 3 462 390        | 0,05              |
| 1 175 000 5.807% Santander Holdings USA Inc 09/09/2026                  | 1 153 780        | 0,02              | 340 000 5.500% Shell International Finance BV 25/03/2040                | 361 247          | 0,01              |
| 901 000 3.244% Santander Holdings USA Inc 05/10/2026                    | 815 207          | 0,01              | 639 000 2.875% Shell International Finance BV 26/11/2041                | 488 624          | 0,01              |
| 2 615 000 4.400% Santander Holdings USA Inc 13/07/2027                  | 2 468 455        | 0,04              | 500 000 3.625% Shell International Finance BV 21/08/2042                | 421 150          | 0,01              |
| 1 000 000 6.499% Santander Holdings USA Inc 09/03/2029                  | 1 002 030        | 0,01              | 2 000 000 4.550% Shell International Finance BV 12/08/2043              | 1 893 620        | 0,03              |
| 2 421 000 1.532% Santander UK Group Holdings PLC 21/08/2026             | 2 162 316        | 0,03              | 3 850 000 4.375% Shell International Finance BV 11/05/2045              | 3 553 973        | 0,05              |
| 1 165 000 6.833% Santander UK Group Holdings PLC 21/11/2026             | 1 180 856        | 0,02              | 3 000 000 4.000% Shell International Finance BV 10/05/2046              | 2 613 900        | 0,04              |
| 3 160 000 1.673% Santander UK Group Holdings PLC 14/06/2027             | 2 752 708        | 0,04              | 2 000 000 3.250% Shell International Finance BV 06/04/2050              | 1 525 960        | 0,02              |
| 200 000 2.469% Santander UK Group Holdings PLC 11/01/2028               | 175 814          | 0,00              | 1 000 000 3.000% Shell International Finance BV 26/11/2051              | 719 890          | 0,01              |
| 414 000 3.823% Santander UK Group Holdings PLC 03/11/2028               | 378 839          | 0,01              | 525 000 4.050% Sherwin-Williams Co 08/08/2024                           | 519 047          | 0,01              |
| 2 080 000 6.534% Santander UK Group Holdings PLC 10/01/2029             | 2 115 776        | 0,03              | 525 000 4.250% Sherwin-Williams Co 08/08/2025                           | 519 010          | 0,01              |
| 200 000 2.896% Santander UK Group Holdings PLC 15/03/2032               | 162 208          | 0,00              | 300 000 3.950% Sherwin-Williams Co 15/01/2026                           | 292 572          | 0,00              |
| 1 215 000 3.300% Sempra Energy 01/04/2025                               | 1 176 898        | 0,02              | 1 350 000 3.450% Sherwin-Williams Co 01/06/2027                         | 1 291 410        | 0,02              |
|   |                  |                   | 50 000 2.300% Sherwin-Williams Co 15/05/2030                            | 42 428           | 0,00              |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets  | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|--|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |  | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |  | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |  | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 2 000 000   | 4.500%           | Sherwin-Williams Co<br>01/06/2047                        | 1 767 060   | 0,03             |                   |
| 1 850 000   | 3.800%           | Sherwin-Williams Co<br>15/08/2049                        | 1 439 170   | 0,02             |                   |
| 1 300 000   | 2.900%           | Sherwin-Williams Co<br>15/03/2052                        | 835 783   | 0,01             |                   |
| 5 018 000   | 3.200%           | Shire Acquisitions Investments<br>Ireland DAC 23/09/2026 | 4 775 028   | 0,07             |                   |
| 2 232 000   | 2.000%           | Simon Property Group LP<br>13/09/2024                    | 2 133 613   | 0,03             |                   |
| 1 198 000   | 3.375%           | Simon Property Group LP<br>01/10/2024                    | 1 169 032   | 0,02             |                   |
| 2 078 000   | 3.500%           | Simon Property Group LP<br>01/09/2025                    | 2 005 582   | 0,03             |                   |
| 1 064 000   | 3.300%           | Simon Property Group LP<br>15/01/2026                    | 1 018 610   | 0,01             |                   |
| 3 000   | 3.250%           | Simon Property Group LP<br>30/11/2026                    | 2 838   | 0,00             |                   |
| 1 015 000   | 3.375%           | Simon Property Group LP<br>15/06/2027                    | 953 481   | 0,01             |                   |
| 2 132 000   | 3.375%           | Simon Property Group LP<br>01/12/2027                    | 1 989 582   | 0,03             |                   |
| 374 000   | 1.750%           | Simon Property Group LP<br>01/02/2028                    | 322 126   | 0,00             |                   |
| 2 960 000   | 2.450%           | Simon Property Group LP<br>13/09/2029                    | 2 534 500   | 0,04             |                   |
| 1 250 000   | 2.650%           | Simon Property Group LP<br>15/07/2030                    | 1 053 175   | 0,02             |                   |
| 1 457 000   | 2.200%           | Simon Property Group LP<br>01/02/2031                    | 1 173 614   | 0,02             |                   |
| 1 000 000   | 5.500%           | Simon Property Group LP<br>08/03/2033                    | 996 720   | 0,01             |                   |
| 625 000   | 6.750%           | Simon Property Group LP<br>01/02/2040                    | 695 269   | 0,01             |                   |
| 26 000  | 4.750%           | Simon Property Group LP<br>15/03/2042                    | 22 942  | 0,00             |                   |
| 50 000  | 4.250%           | Simon Property Group LP<br>01/10/2044                    | 40 557  | 0,00             |                   |
| 523 000   | 4.250%           | Simon Property Group LP<br>30/11/2046                    | 432 354   | 0,01             |                   |
| 1 350 000   | 3.250%           | Simon Property Group LP<br>13/09/2049                    | 914 760   | 0,01             |                   |
| 600 000   | 3.800%           | Simon Property Group LP<br>15/07/2050                    | 445 368   | 0,01             |                   |
| 1 000 000   | 5.850%           | Simon Property Group LP<br>08/03/2053                    | 1 000 780   | 0,01             |                   |
| 3 928 000   | 2.032%           | Smith & Nephew PLC<br>14/10/2030                         | 3 185 412   | 0,05             |                   |
| 50 000  | 3.150%           | Southern California Gas Co<br>15/09/2024                 | 48 844  | 0,00             |                   |
| 36 000  | 2.600%           | Southern California Gas Co<br>15/06/2026                 | 34 031  | 0,00             |                   |
| 525 000   | 2.550%           | Southern California Gas Co<br>01/02/2030                 | 458 346   | 0,01             |                   |
| 125 000   | 5.125%           | Southern California Gas Co<br>15/11/2040                 | 123 615   | 0,00             |                   |
| 2 035 000   | 3.750%           | Southern California Gas Co<br>15/09/2042                 | 1 668 578   | 0,02             |                   |
| 1 345 000   | 4.125%           | Southern California Gas Co<br>01/06/2048                 | 1 116 727   | 0,02             |                   |
| 302 000   | 4.300%           | Southern California Gas Co<br>15/01/2049                 | 257 784   | 0,00             |                   |
| 1 570 000   | 3.950%           | Southern California Gas Co<br>15/02/2050                 | 1 252 106   | 0,02             |                   |
| 1 000 000   | 6.350%           | Southern California Gas Co<br>15/11/2052                 | 1 151 420   | 0,02             |                   |
| 423 000   | 4.100%           | Southwestern Electric Power Co<br>15/09/2028             | 409 011   | 0,01             |                   |
| 1 110 000   | 6.200%           | Southwestern Electric Power Co<br>15/03/2040             | 1 166 488   | 0,02             |                   |
| 3 015 000   | 3.900%           | Southwestern Electric Power Co<br>01/04/2045             | 2 384 955   | 0,03             |                   |
| 555 000   | 3.850%           | Southwestern Electric Power Co<br>01/02/2048             | 428 654   | 0,01             |                   |
| 3 370 000   | 3.400%           | Southwestern Public Service Co<br>15/08/2046             | 2 492 856   | 0,04             |                   |
| 500 000   | 4.400%           | Southwestern Public Service Co<br>15/11/2048             | 437 100   | 0,01             |                   |
| 3 000 000   | 3.500%           | Spectra Energy Partners LP<br>15/03/2025                 | 2 909 070   | 0,04             |                   |
| 960 000   | 3.375%           | Spectra Energy Partners LP<br>15/10/2026                 | 912 144   | 0,01             |                   |
| 2 750 000   | 5.950%           | Spectra Energy Partners LP<br>25/09/2043                 | 2 772 632   | 0,04             |                   |
| 2 500 000   | 2.300%           | Stanley Black & Decker Inc<br>24/02/2025                 | 2 384 375   | 0,03             |                   |
| 450 000   | 3.400%           | Stanley Black & Decker Inc<br>01/03/2026                 | 431 118   | 0,01             |                   |
| 2 000 000   | 6.272%           | Stanley Black & Decker Inc<br>06/03/2026                 | 2 026 940   | 0,03             |                   |
| 859 000   | 2.300%           | Stanley Black & Decker Inc<br>15/03/2030                 | 713 142   | 0,01             |                   |
| 194 000   | 5.200%           | Stanley Black & Decker Inc<br>01/09/2040                 | 181 869   | 0,00             |                   |
| 2 136 000   | 4.850%           | Stanley Black & Decker Inc<br>15/11/2048                 | 1 815 450   | 0,03             |                   |
| 1 025 000   | 2.750%           | Stanley Black & Decker Inc<br>15/11/2050                 | 607 241   | 0,01             |                   |
| 11 389 000  | 4.000%           | Stanley Black & Decker Inc<br>15/03/2060                 | 8 992 527   | 0,13             |                   |
| 720 000   | 6.800%           | Suncor Energy Inc 15/05/2038                             | 790 697   | 0,01             |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 3 951 000 6.500% Suncor Energy Inc 15/06/2038                           | 4 239 186        | 0,06              |
| 83 000 4.000% Suncor Energy Inc 15/11/2047                              | 65 945           | 0,00              |
| 1 256 000 5.000% Takeda Pharmaceutical Co Ltd 26/11/2028                | 1 270 067        | 0,02              |
| 2 976 000 2.050% Takeda Pharmaceutical Co Ltd 31/03/2030                | 2 511 417        | 0,04              |
| 2 473 000 3.025% Takeda Pharmaceutical Co Ltd 09/07/2040                | 1 886 800        | 0,03              |
| 3 087 000 3.175% Takeda Pharmaceutical Co Ltd 09/07/2050                | 2 208 224        | 0,03              |
| 1 950 000 3.375% Takeda Pharmaceutical Co Ltd 09/07/2060                | 1 370 908        | 0,02              |
| 858 000 3.500% Target Corp 01/07/2024                                   | 846 812          | 0,01              |
| 3 100 000 2.250% Target Corp 15/04/2025                                 | 2 978 666        | 0,04              |
| 200 000 2.500% Target Corp 15/04/2026                                   | 191 980          | 0,00              |
| 569 000 3.375% Target Corp 15/04/2029                                   | 545 102          | 0,01              |
| 647 000 2.350% Target Corp 15/02/2030                                   | 569 114          | 0,01              |
| 470 000 2.650% Target Corp 15/09/2030                                   | 416 613          | 0,01              |
| 2 000 000 4.500% Target Corp 15/09/2032                                 | 2 005 020        | 0,03              |
| 50 000 6.350% Target Corp 01/11/2032                                    | 56 748           | 0,00              |
| 500 000 4.400% Target Corp 15/01/2033                                   | 496 875          | 0,01              |
| 821 000 6.500% Target Corp 15/10/2037                                   | 959 380          | 0,01              |
| 400 000 7.000% Target Corp 15/01/2038                                   | 489 024          | 0,01              |
| 520 000 4.000% Target Corp 01/07/2042                                   | 475 202          | 0,01              |
| 1 805 000 3.625% Target Corp 15/04/2046                                 | 1 502 518        | 0,02              |
| 1 236 000 3.900% Target Corp 15/11/2047                                 | 1 067 385        | 0,02              |
| 500 000 2.950% Target Corp 15/01/2052                                   | 361 705          | 0,01              |
| 500 000 4.800% Target Corp 15/01/2053                                   | 491 250          | 0,01              |
| 2 269 000 3.900% Teck Resources Ltd 15/07/2030                          | 2 082 057        | 0,03              |
| 8 455 000 6.125% Teck Resources Ltd 01/10/2035                          | 8 767 920        | 0,13              |
| 2 222 000 6.000% Teck Resources Ltd 15/08/2040                          | 2 243 953        | 0,03              |
| 9 423 000 6.250% Teck Resources Ltd 15/07/2041                          | 9 733 205        | 0,14              |
| 5 622 000 5.200% Teck Resources Ltd 01/03/2042                          | 5 142 106        | 0,08              |
| 7 222 000 5.400% Teck Resources Ltd 01/02/2043                          | 6 738 993        | 0,10              |
| 2 556 000 4.103% Telefonica Emisiones SA 08/03/2027                     | 2 471 141        | 0,04              |
| 6 781 000 7.045% Telefonica Emisiones SA 20/06/2036                     | 7 463 982        | 0,11              |
| 2 110 000 4.665% Telefonica Emisiones SA 06/03/2038                     | 1 849 795        | 0,03              |
| 32 922 000 5.213% Telefonica Emisiones SA 08/03/2047                    | 28 794 240       | 0,42              |
| 13 650 000 4.895% Telefonica Emisiones SA 06/03/2048                    | 11 282 407       | 0,17              |
| 10 738 000 5.520% Telefonica Emisiones SA 01/03/2049                    | 9 642 187        | 0,14              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 2 800 000 8.250% Telefonica Europe BV 15/09/2030                        | 3 271 632        | 0,05              |
| 3 000 2.800% TELUS Corp 16/02/2027                                      | 2 814            | 0,00              |
| 2 900 000 3.700% TELUS Corp 15/09/2027                                  | 2 804 590        | 0,04              |
| 50 000 3.400% TELUS Corp 13/05/2032                                     | 43 885           | 0,00              |
| 601 000 4.600% TELUS Corp 16/11/2048                                    | 534 908          | 0,01              |
| 380 000 4.300% TELUS Corp 15/06/2049                                    | 319 892          | 0,00              |
| 200 000 7.000% Tennessee Gas Pipeline Co LLC 15/10/2028                 | 217 426          | 0,00              |
| 50 000 7.000% Texas Eastern Transmission LP 15/07/2032                  | 57 760           | 0,00              |
| 250 000 4.700% Texas Instruments Inc 18/11/2024                         | 251 638          | 0,00              |
| 670 000 1.375% Texas Instruments Inc 12/03/2025                         | 632 514          | 0,01              |
| 120 000 2.900% Texas Instruments Inc 03/11/2027                         | 114 142          | 0,00              |
| 455 000 4.600% Texas Instruments Inc 15/02/2028                         | 464 728          | 0,01              |
| 5 277 000 2.250% Texas Instruments Inc 04/09/2029                       | 4 710 778        | 0,07              |
| 933 000 1.750% Texas Instruments Inc 04/05/2030                         | 791 016          | 0,01              |
| 555 000 3.650% Texas Instruments Inc 16/08/2032                         | 527 261          | 0,01              |
| 1 000 000 4.900% Texas Instruments Inc 14/03/2033                       | 1 041 700        | 0,02              |
| 2 000 3.875% Texas Instruments Inc 15/03/2039                           | 1 823            | 0,00              |
| 2 017 000 4.150% Texas Instruments Inc 15/05/2048                       | 1 875 064        | 0,03              |
| 715 000 4.100% Texas Instruments Inc 16/08/2052                         | 658 265          | 0,01              |
| 1 000 000 5.000% Texas Instruments Inc 14/03/2053                       | 1 047 950        | 0,02              |
| 3 300 000 1.215% Thermo Fisher Scientific Inc 18/10/2024                | 3 134 340        | 0,05              |
| 3 002 000 3.350% Thomson Reuters Corp 15/05/2026                        | 2 868 261        | 0,04              |
| 500 000 5.850% Thomson Reuters Corp 15/04/2040                          | 498 930          | 0,01              |
| 3 320 000 2.650% Toronto-Dominion Bank 12/06/2024                       | 3 228 932        | 0,05              |
| 2 000 000 0.700% Toronto-Dominion Bank 10/09/2024                       | 1 879 560        | 0,03              |
| 1 450 000 4.285% Toronto-Dominion Bank 13/09/2024                       | 1 433 310        | 0,02              |
| 1 500 000 3.766% Toronto-Dominion Bank 06/06/2025                       | 1 460 850        | 0,02              |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation | Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation | Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---------------|---|------------------|-------------------|---------------|---|------------------|-------------------|
|               | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %)</b><br><b>(suite)</b>       |                  |                   |               | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %)</b><br><b>(suite)</b>       |                  |                   |
|               | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %)</b><br><b>(suite)</b> |                  |                   |               | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %)</b><br><b>(suite)</b> |                  |                   |
|               | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>   |                  |                   |               | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 1 250 000     | 1.150% Toronto-Dominion Bank<br>12/06/2025  | 1 151 525        | 0,02              | 377 000       | 3.669% Toyota Motor Corp 20/07/2028   | 366 923          | 0,01              |
| 960 000       | 0.750% Toronto-Dominion Bank<br>11/09/2025  | 864 384          | 0,01              | 640 000       | 0.500% Toyota Motor Credit Corp<br>18/06/2024                                     | 609 024          | 0,01              |
| 4 382 000     | 0.750% Toronto-Dominion Bank<br>06/01/2026  | 3 912 863        | 0,06              | 2 600 000     | 0.625% Toyota Motor Credit Corp<br>13/09/2024                                     | 2 456 870        | 0,04              |
| 500 000       | 5.103% Toronto-Dominion Bank<br>09/01/2026  | 502 735          | 0,01              | 1 000 000     | 4.400% Toyota Motor Credit Corp<br>20/09/2024                                     | 998 070          | 0,01              |
| 1 500 000     | 1.200% Toronto-Dominion Bank<br>03/06/2026  | 1 336 140        | 0,02              | 1 000 000     | 2.000% Toyota Motor Credit Corp<br>07/10/2024                                     | 961 700          | 0,01              |
| 2 200 000     | 1.250% Toronto-Dominion Bank<br>10/09/2026  | 1 946 538        | 0,03              | 1 000 000     | 4.800% Toyota Motor Credit Corp<br>10/01/2025                                     | 1 006 810        | 0,01              |
| 2 500 000     | 1.950% Toronto-Dominion Bank<br>12/01/2027  | 2 244 690        | 0,03              | 525 000       | 1.450% Toyota Motor Credit Corp<br>13/01/2025                                     | 497 102          | 0,01              |
| 300 000       | 2.800% Toronto-Dominion Bank<br>10/03/2027  | 277 251          | 0,00              | 1 049 000     | 1.800% Toyota Motor Credit Corp<br>13/02/2025                                     | 998 805          | 0,01              |
| 2 000 000     | 4.108% Toronto-Dominion Bank<br>08/06/2027  | 1 937 580        | 0,03              | 3 827 000     | 3.000% Toyota Motor Credit Corp<br>01/04/2025                                     | 3 707 445        | 0,05              |
| 2 250 000     | 4.693% Toronto-Dominion Bank<br>15/09/2027  | 2 227 770        | 0,03              | 789 000       | 3.400% Toyota Motor Credit Corp<br>14/04/2025                                     | 769 930          | 0,01              |
| 2 000 000     | 5.156% Toronto-Dominion Bank<br>10/01/2028  | 2 021 480        | 0,03              | 1 765 000     | 3.650% Toyota Motor Credit Corp<br>18/08/2025                                     | 1 727 582        | 0,03              |
| 12 300 000    | 2.000% Toronto-Dominion Bank<br>10/09/2031  | 9 896 322        | 0,14              | 1 535 000     | 0.800% Toyota Motor Credit Corp<br>16/10/2025                                     | 1 399 490        | 0,02              |
| 26 353 000    | 3.625% Toronto-Dominion Bank<br>15/09/2031  | 24 944 169       | 0,36              | 1 000 000     | 5.400% Toyota Motor Credit Corp<br>10/11/2025                                     | 1 026 110        | 0,02              |
| 8 450 000     | 2.450% Toronto-Dominion Bank<br>12/01/2032  | 7 008 514        | 0,10              | 2 550 000     | 0.800% Toyota Motor Credit Corp<br>09/01/2026                                     | 2 312 467        | 0,03              |
| 8 300 000     | 3.200% Toronto-Dominion Bank<br>10/03/2032  | 7 299 323        | 0,11              | 2 523 000     | 3.200% Toyota Motor Credit Corp<br>11/01/2027                                     | 2 417 211        | 0,04              |
| 5 790 000     | 4.456% Toronto-Dominion Bank<br>08/06/2032  | 5 609 352        | 0,08              | 75 000        | 1.900% Toyota Motor Credit Corp<br>13/01/2027                                     | 68 397           | 0,00              |
| 500 000       | 8.125% Tosco Corp 15/02/2030  | 595 135          | 0,01              | 2 000 000     | 3.050% Toyota Motor Credit Corp<br>22/03/2027                                     | 1 898 660        | 0,03              |
| 1 000 000     | 3.750% TotalEnergies Capital<br>International SA 10/04/2024                       | 993 260          | 0,01              | 209 000       | 1.150% Toyota Motor Credit Corp<br>13/08/2027                                     | 182 269          | 0,00              |
| 3 500 000     | 2.434% TotalEnergies Capital<br>International SA 10/01/2025                       | 3 386 950        | 0,05              | 1 000 000     | 4.550% Toyota Motor Credit Corp<br>20/09/2027                                     | 1 004 740        | 0,01              |
| 2 600 000     | 3.455% TotalEnergies Capital<br>International SA 19/02/2029                       | 2 482 090        | 0,04              | 1 000 000     | 5.450% Toyota Motor Credit Corp<br>10/11/2027                                     | 1 038 300        | 0,02              |
| 650 000       | 2.829% TotalEnergies Capital<br>International SA 10/01/2030                       | 592 742          | 0,01              | 635 000       | 4.625% Toyota Motor Credit Corp<br>12/01/2028                                     | 642 614          | 0,01              |
| 3 068 000     | 2.986% TotalEnergies Capital<br>International SA 29/06/2041                       | 2 397 274        | 0,04              | 4 000         | 3.650% Toyota Motor Credit Corp<br>08/01/2029                                     | 3 853            | 0,00              |
| 2 300 000     | 3.461% TotalEnergies Capital<br>International SA 12/07/2049                       | 1 823 486        | 0,03              | 2 000 000     | 4.450% Toyota Motor Credit Corp<br>29/06/2029                                     | 2 018 040        | 0,03              |
| 2 000 000     | 3.127% TotalEnergies Capital<br>International SA 29/05/2050                       | 1 482 860        | 0,02              | 3 687 000     | 2.150% Toyota Motor Credit Corp<br>13/02/2030                                     | 3 239 619        | 0,05              |
| 1 000 000     | 3.386% TotalEnergies Capital<br>International SA 29/06/2060                       | 749 780          | 0,01              | 250 000       | 3.375% Toyota Motor Credit Corp<br>01/04/2030                                     | 235 370          | 0,00              |
| 9 000         | 2.358% Toyota Motor Corp 02/07/2024   | 8 747            | 0,00              | 295 000       | 1.650% Toyota Motor Credit Corp<br>10/01/2031                                     | 241 611          | 0,00              |
| 140 000       | 1.339% Toyota Motor Corp 25/03/2026   | 127 924          | 0,00              |               |   |                  |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets                                      | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|--|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |  | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |  | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |  | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 700 000   | 4.700%           | Toyota Motor Credit Corp<br>12/01/2033                 | 710 283   | 0,01             |                   |
| 1 830 000   | 5.250%           | Trane Technologies Financing<br>Ltd 03/03/2033         | 1 891 909   | 0,03             |                   |
| 2 000 000   | 3.750%           | Trane Technologies Global<br>Holding Co Ltd 21/08/2028 | 1 936 520   | 0,03             |                   |
| 1 005 000   | 5.750%           | Trane Technologies Global<br>Holding Co Ltd 15/06/2043 | 1 050 416   | 0,02             |                   |
| 850 000   | 4.300%           | Trane Technologies Global<br>Holding Co Ltd 21/02/2048 | 731 094   | 0,01             |                   |
| 1 158 000   | 3.550%           | Trane Technologies<br>Luxembourg Finance SA 01/11/2024 | 1 131 933   | 0,02             |                   |
| 368 000   | 3.500%           | Trane Technologies<br>Luxembourg Finance SA 21/03/2026 | 357 023   | 0,01             |                   |
| 2 065 000   | 3.800%           | Trane Technologies<br>Luxembourg Finance SA 21/03/2029 | 1 957 826   | 0,03             |                   |
| 100 000   | 4.650%           | Trane Technologies<br>Luxembourg Finance SA 01/11/2044 | 90 175  | 0,00             |                   |
| 162 000   | 4.500%           | Trane Technologies<br>Luxembourg Finance SA 21/03/2049 | 142 955   | 0,00             |                   |
| 1 000 000   | 4.875%           | TransCanada PipeLines Ltd<br>15/01/2026                | 997 660   | 0,01             |                   |
| 4 000 000   | 4.250%           | TransCanada PipeLines Ltd<br>15/05/2028                | 3 881 680   | 0,06             |                   |
| 2 000 000   | 4.100%           | TransCanada PipeLines Ltd<br>15/04/2030                | 1 879 900   | 0,03             |                   |
| 2 000 000   | 2.500%           | TransCanada PipeLines Ltd<br>12/10/2031                | 1 634 820   | 0,02             |                   |
| 100 000   | 4.625%           | TransCanada PipeLines Ltd<br>01/03/2034                | 93 811  | 0,00             |                   |
| 1 080 000   | 4.750%           | TransCanada PipeLines Ltd<br>15/05/2038                | 1 003 417   | 0,01             |                   |
| 3 190 000   | 7.625%           | TransCanada PipeLines Ltd<br>15/01/2039                | 3 781 968   | 0,06             |                   |
| 1 230 000   | 6.100%           | TransCanada PipeLines Ltd<br>01/06/2040                | 1 266 826   | 0,02             |                   |
| 1 000 000   | 5.000%           | TransCanada PipeLines Ltd<br>16/10/2043                | 908 980   | 0,01             |                   |
| 500 000   | 4.875%           | TransCanada PipeLines Ltd<br>15/05/2048                | 448 390   | 0,01             |                   |
| 510 000   | 4.000%           | Transcontinental Gas Pipe Line<br>Co LLC 15/03/2028    | 488 402   | 0,01             |                   |
| 3 000 000   | 3.250%           | Transcontinental Gas Pipe Line<br>Co LLC 15/05/2030    | 2 718 390   | 0,04             |                   |
| 540 000   | 5.400%           | Transcontinental Gas Pipe Line<br>Co LLC 15/08/2041    | 533 498   | 0,01             |                   |
| 470 000   | 4.450%           | Transcontinental Gas Pipe Line<br>Co LLC 01/08/2042    | 413 083   | 0,01             |                   |
| 1 000 000   | 4.600%           | Transcontinental Gas Pipe Line<br>Co LLC 15/03/2048    | 874 190   | 0,01             |                   |
| 1 000 000   | 3.950%           | Transcontinental Gas Pipe Line<br>Co LLC 15/05/2050    | 795 740   | 0,01             |                   |
| 646 000   | 6.250%           | Travelers Cos Inc 15/06/2037                           | 731 466   | 0,01             |                   |
| 1 000 000   | 5.350%           | Travelers Cos Inc 01/11/2040                           | 1 057 130   | 0,02             |                   |
| 1 200 000   | 4.600%           | Travelers Cos Inc 01/08/2043                           | 1 128 576   | 0,02             |                   |
| 339 000   | 4.300%           | Travelers Cos Inc 25/08/2045                           | 305 781   | 0,00             |                   |
| 388 000   | 3.750%           | Travelers Cos Inc 15/05/2046                           | 316 414   | 0,00             |                   |
| 860 000   | 4.000%           | Travelers Cos Inc 30/05/2047                           | 739 075   | 0,01             |                   |
| 2 400 000   | 4.050%           | Travelers Cos Inc 07/03/2048                           | 2 071 320   | 0,03             |                   |
| 187 000   | 4.100%           | Travelers Cos Inc 04/03/2049                           | 161 007   | 0,00             |                   |
| 400 000   | 2.550%           | Travelers Cos Inc 27/04/2050                           | 261 964   | 0,00             |                   |
| 442 000   | 3.050%           | Travelers Cos Inc 08/06/2051                           | 315 283   | 0,00             |                   |
| 1 000 000   | 6.375%           | Travelers Property Casualty<br>Corp 15/03/2033         | 1 143 040   | 0,02             |                   |
| 1 725 000   | 1.750%           | TSMC Arizona Corp 25/10/2026                           | 1 566 127   | 0,02             |                   |
| 610 000   | 3.875%           | TSMC Arizona Corp 22/04/2027                           | 598 373   | 0,01             |                   |
| 1 000 000   | 4.125%           | TSMC Arizona Corp 22/04/2029                           | 981 470   | 0,01             |                   |
| 2 872 000   | 2.500%           | TSMC Arizona Corp 25/10/2031                           | 2 465 325   | 0,04             |                   |
| 1 065 000   | 4.250%           | TSMC Arizona Corp 22/04/2032                           | 1 044 989   | 0,02             |                   |
| 1 220 000   | 3.125%           | TSMC Arizona Corp 25/10/2041                           | 983 052   | 0,01             |                   |
| 2 600 000   | 3.250%           | TSMC Arizona Corp 25/10/2051                           | 2 027 766   | 0,03             |                   |
| 1 190 000   | 4.500%           | TSMC Arizona Corp 22/04/2052                           | 1 155 526   | 0,02             |                   |
| 400 000   | 5.150%           | Tyson Foods Inc 15/08/2044                             | 379 116   | 0,01             |                   |
| 1 300 000   | 4.550%           | Tyson Foods Inc 02/06/2047                             | 1 125 566   | 0,02             |                   |
| 300 000   | 5.100%           | Tyson Foods Inc 28/09/2048                             | 282 909   | 0,00             |                   |
| 97 000  | 3.500%           | UDR Inc 01/07/2027                                     | 92 078  | 0,00             |                   |
| 280 000   | 3.500%           | UDR Inc 15/01/2028                                     | 261 750   | 0,00             |                   |
| 500 000   | 4.400%           | UDR Inc 26/01/2029                                     | 480 235   | 0,01             |                   |
| 384 000   | 3.200%           | UDR Inc 15/01/2030                                     | 343 400   | 0,01             |                   |
| 133 000   | 3.000%           | UDR Inc 15/08/2031                                     | 113 877   | 0,00             |                   |
| 1 657 000   | 2.100%           | UDR Inc 01/08/2032                                     | 1 274 564   | 0,02             |                   |
| 1 000 000   | 3.100%           | UDR Inc 01/11/2034                                     | 816 460   | 0,01             |                   |
| 20 731 000  | 2.600%           | Unilever Capital Corp<br>05/05/2024                    | 20 264 138  | 0,30             |                   |
| 4 675 000   | 0.626%           | Unilever Capital Corp<br>12/08/2024                    | 4 415 444   | 0,06             |                   |
| 433 000   | 3.375%           | Unilever Capital Corp<br>22/03/2025                    | 423 063   | 0,01             |                   |
| 5 980 000   | 3.100%           | Unilever Capital Corp<br>30/07/2025                    | 5 777 039   | 0,08             |                   |
| 11 370 000  | 2.000%           | Unilever Capital Corp<br>28/07/2026                    | 10 632 542  | 0,16             |                   |
| 12 577 000  | 2.900%           | Unilever Capital Corp<br>05/05/2027                    | 11 950 665  | 0,17             |                   |
| 21 499 000  | 3.500%           | Unilever Capital Corp<br>22/03/2028                    | 20 777 279  | 0,30             |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets                     | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|---------------------------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                                       | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                                       | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                                       | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 12 386 000  | 2.125%           | Unilever Capital Corp 06/09/2029      | 10 829 575  | 0,16             |                   |
| 1 440 000   | 1.375%           | Unilever Capital Corp 14/09/2030      | 1 173 081   | 0,02             |                   |
| 1 900 000   | 1.750%           | Unilever Capital Corp 12/08/2031      | 1 562 104   | 0,02             |                   |
| 14 727 000  | 5.900%           | Unilever Capital Corp 15/11/2032      | 16 496 302  | 0,24             |                   |
| 6 500 000   | 2.625%           | Unilever Capital Corp 12/08/2051      | 4 494 360   | 0,07             |                   |
| 1 200 000   | 6.875%           | United Utilities PLC 15/08/2028       | 1 316 076   | 0,02             |                   |
| 2 000 000   | 3.950%           | Utah Acquisition Sub Inc 15/06/2026   | 1 903 700   | 0,03             |                   |
| 1 800 000   | 5.250%           | Utah Acquisition Sub Inc 15/06/2046   | 1 429 938   | 0,02             |                   |
| 1 039 000   | 3.500%           | Ventas Realty LP 15/04/2024           | 1 016 256   | 0,01             |                   |
| 1 307 000   | 2.650%           | Ventas Realty LP 15/01/2025           | 1 244 787   | 0,02             |                   |
| 503 000   | 3.500%           | Ventas Realty LP 01/02/2025           | 484 409   | 0,01             |                   |
| 3 754 000   | 4.125%           | Ventas Realty LP 15/01/2026           | 3 644 120   | 0,05             |                   |
| 1 000 000   | 3.250%           | Ventas Realty LP 15/10/2026           | 934 250   | 0,01             |                   |
| 75 000  | 3.850%           | Ventas Realty LP 01/04/2027           | 71 196  | 0,00             |                   |
| 202 000   | 4.000%           | Ventas Realty LP 01/03/2028           | 190 029   | 0,00             |                   |
| 550 000   | 4.400%           | Ventas Realty LP 15/01/2029           | 522 412   | 0,01             |                   |
| 100 000   | 3.000%           | Ventas Realty LP 15/01/2030           | 86 348  | 0,00             |                   |
| 3 751 000   | 4.750%           | Ventas Realty LP 15/11/2030           | 3 622 191   | 0,05             |                   |
| 940 000   | 5.700%           | Ventas Realty LP 30/09/2043           | 909 572   | 0,01             |                   |
| 3 000 000   | 4.375%           | Ventas Realty LP 01/02/2045           | 2 437 890   | 0,04             |                   |
| 500 000   | 4.875%           | Ventas Realty LP 15/04/2049           | 434 140   | 0,01             |                   |
| 3 118 000   | 4.000%           | Verisk Analytics Inc 15/06/2025       | 3 049 373   | 0,04             |                   |
| 444 000   | 4.125%           | Verisk Analytics Inc 15/03/2029       | 425 712   | 0,01             |                   |
| 1 165 000   | 5.750%           | Verisk Analytics Inc 01/04/2033       | 1 225 254   | 0,02             |                   |
| 1 015 000   | 3.625%           | Verisk Analytics Inc 15/05/2050       | 738 473   | 0,01             |                   |
| 1 040 000   | 3.500%           | Verizon Communications Inc 01/11/2024 | 1 021 134   | 0,02             |                   |
| 1 413 000   | 3.376%           | Verizon Communications Inc 15/02/2025 | 1 385 475   | 0,02             |                   |
| 1 260 000   | 0.850%           | Verizon Communications Inc 20/11/2025 | 1 147 545   | 0,02             |                   |
| 3 565 000   | 1.450%           | Verizon Communications Inc 20/03/2026 | 3 280 905   | 0,05             |                   |
| 1 683 000   | 2.625%           | Verizon Communications Inc 15/08/2026 | 1 591 192   | 0,02             |                   |
| 5 170 000   | 4.125%           | Verizon Communications Inc 16/03/2027 | 5 127 968   | 0,08             |                   |
| 4 506 000   | 3.000%           | Verizon Communications Inc 22/03/2027 | 4 282 322   | 0,06             |                   |
| 5 300 000   | 2.100%           | Verizon Communications Inc 22/03/2028 | 4 722 247   | 0,07             |                   |
| 4 122 000   | 4.329%           | Verizon Communications Inc 21/09/2028 | 4 069 280   | 0,06             |                   |
| 450 000   | 3.875%           | Verizon Communications Inc 08/02/2029 | 434 615   | 0,01             |                   |
| 4 854 000   | 4.016%           | Verizon Communications Inc 03/12/2029 | 4 649 161   | 0,07             |                   |
| 2 643 000   | 3.150%           | Verizon Communications Inc 22/03/2030 | 2 407 747   | 0,04             |                   |
| 500 000   | 1.500%           | Verizon Communications Inc 18/09/2030 | 403 710   | 0,01             |                   |
| 1 393 000   | 1.680%           | Verizon Communications Inc 30/10/2030 | 1 124 527   | 0,02             |                   |
| 700 000   | 7.750%           | Verizon Communications Inc 01/12/2030 | 818 965   | 0,01             |                   |
| 2 241 000   | 1.750%           | Verizon Communications Inc 20/01/2031 | 1 804 520   | 0,03             |                   |
| 4 860 000   | 2.550%           | Verizon Communications Inc 21/03/2031 | 4 140 477   | 0,06             |                   |
| 3 500 000   | 2.355%           | Verizon Communications Inc 15/03/2032 | 2 871 575   | 0,04             |                   |
| 5 155 000   | 4.400%           | Verizon Communications Inc 01/11/2034 | 4 896 683   | 0,07             |                   |
| 3 170 000   | 4.272%           | Verizon Communications Inc 15/01/2036 | 2 945 405   | 0,04             |                   |
| 2 150 000   | 5.250%           | Verizon Communications Inc 16/03/2037 | 2 210 178   | 0,03             |                   |
| 450 000   | 4.812%           | Verizon Communications Inc 15/03/2039 | 430 596   | 0,01             |                   |
| 5 896 000   | 2.650%           | Verizon Communications Inc 20/11/2040 | 4 210 982   | 0,06             |                   |
| 6 580 000   | 3.400%           | Verizon Communications Inc 22/03/2041 | 5 237 614   | 0,08             |                   |
| 1 330 000   | 2.850%           | Verizon Communications Inc 03/09/2041 | 969 730   | 0,01             |                   |
| 5 571 000   | 4.750%           | Verizon Communications Inc 01/11/2041 | 5 357 686   | 0,08             |                   |
| 1 500 000   | 3.850%           | Verizon Communications Inc 01/11/2042 | 1 250 775   | 0,02             |                   |
| 550 000   | 6.550%           | Verizon Communications Inc 15/09/2043 | 624 723   | 0,01             |                   |
| 3 219 000   | 4.125%           | Verizon Communications Inc 15/08/2046 | 2 754 724   | 0,04             |                   |
| 3 750 000   | 4.862%           | Verizon Communications Inc 21/08/2046 | 3 567 857   | 0,05             |                   |
| 2 000 000   | 5.500%           | Verizon Communications Inc 16/03/2047 | 2 029 840   | 0,03             |                   |
| 4 200 000   | 4.522%           | Verizon Communications Inc 15/09/2048 | 3 787 308   | 0,06             |                   |
| 2 175 000   | 5.012%           | Verizon Communications Inc 15/04/2049 | 2 101 833   | 0,03             |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets                         | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|---|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 1 966 000   | 4.000%           | Verizon Communications Inc 22/03/2050     | 1 634 729   | 0,02             |                   |
| 6 634 000   | 2.875%           | Verizon Communications Inc 20/11/2050     | 4 427 465   | 0,06             |                   |
| 9 335 000   | 3.550%           | Verizon Communications Inc 22/03/2051     | 7 139 781   | 0,10             |                   |
| 300 000   | 3.875%           | Verizon Communications Inc 01/03/2052     | 242 550   | 0,00             |                   |
| 4 100 000   | 5.012%           | Verizon Communications Inc 21/08/2054     | 3 936 410   | 0,06             |                   |
| 7 000 000   | 4.672%           | Verizon Communications Inc 15/03/2055     | 6 332 900   | 0,09             |                   |
| 8 572 000   | 2.987%           | Verizon Communications Inc 30/10/2056     | 5 574 114   | 0,08             |                   |
| 5 888 000   | 3.000%           | Verizon Communications Inc 20/11/2060     | 3 776 210   | 0,06             |                   |
| 6 200 000   | 3.700%           | Verizon Communications Inc 22/03/2061     | 4 635 244   | 0,07             |                   |
| 3 000 000   | 1.650%           | Viatis Inc 22/06/2025                     | 2 755 920   | 0,04             |                   |
| 2 000 000   | 2.700%           | Viatis Inc 22/06/2030                     | 1 629 960   | 0,02             |                   |
| 800 000   | 3.850%           | Viatis Inc 22/06/2040                     | 562 104   | 0,01             |                   |
| 28 000  | 3.100%           | Virginia Electric and Power Co 15/05/2025 | 26 984  | 0,00             |                   |
| 425 000   | 3.150%           | Virginia Electric and Power Co 15/01/2026 | 411 392   | 0,01             |                   |
| 1 000 000   | 2.950%           | Virginia Electric and Power Co 15/11/2026 | 940 760   | 0,01             |                   |
| 578 000   | 3.500%           | Virginia Electric and Power Co 15/03/2027 | 556 059   | 0,01             |                   |
| 2 555 000   | 3.750%           | Virginia Electric and Power Co 15/05/2027 | 2 479 083   | 0,04             |                   |
| 632 000   | 3.800%           | Virginia Electric and Power Co 01/04/2028 | 613 742   | 0,01             |                   |
| 2 000 000   | 2.875%           | Virginia Electric and Power Co 15/07/2029 | 1 812 050   | 0,03             |                   |
| 200 000   | 2.300%           | Virginia Electric and Power Co 15/11/2031 | 166 248   | 0,00             |                   |
| 50 000  | 2.400%           | Virginia Electric and Power Co 30/03/2032 | 41 625  | 0,00             |                   |
| 50 000  | 5.000%           | Virginia Electric and Power Co 01/04/2033 | 50 422  | 0,00             |                   |
| 1 353 000   | 6.000%           | Virginia Electric and Power Co 15/01/2036 | 1 463 581   | 0,02             |                   |
| 451 000   | 6.350%           | Virginia Electric and Power Co 30/11/2037 | 502 842   | 0,01             |                   |
| 1 878 000   | 8.875%           | Virginia Electric and Power Co 15/11/2038 | 2 601 537   | 0,04             |                   |
| 570 000   | 4.000%           | Virginia Electric and Power Co 15/01/2043 | 481 382   | 0,01             |                   |
| 1 572 000   | 4.650%           | Virginia Electric and Power Co 15/08/2043 | 1 430 567   | 0,02             |                   |
| 1 478 000   | 4.450%           | Virginia Electric and Power Co 15/02/2044 | 1 310 158   | 0,02             |                   |
| 650 000   | 4.200%           | Virginia Electric and Power Co 15/05/2045 | 547 102   | 0,01             |                   |
| 500 000   | 4.000%           | Virginia Electric and Power Co 15/11/2046 | 409 985   | 0,01             |                   |
| 1 060 000   | 3.800%           | Virginia Electric and Power Co 15/09/2047 | 846 834   | 0,01             |                   |
| 100 000   | 4.600%           | Virginia Electric and Power Co 01/12/2048 | 90 696  | 0,00             |                   |
| 780 000   | 3.300%           | Virginia Electric and Power Co 01/12/2049 | 578 019   | 0,01             |                   |
| 2 437 000   | 2.450%           | Virginia Electric and Power Co 15/12/2050 | 1 504 043   | 0,02             |                   |
| 7 000 000   | 2.950%           | Virginia Electric and Power Co 15/11/2051 | 4 793 110   | 0,07             |                   |
| 5 000 000   | 4.625%           | Virginia Electric and Power Co 15/05/2052 | 4 530 880   | 0,07             |                   |
| 200 000   | 5.450%           | Virginia Electric and Power Co 01/04/2053 | 204 544   | 0,00             |                   |
| 4 838 000   | 3.150%           | Visa Inc 14/12/2025                       | 4 698 859   | 0,07             |                   |
| 739 000   | 1.900%           | Visa Inc 15/04/2027                       | 681 705   | 0,01             |                   |
| 107 000   | 0.750%           | Visa Inc 15/08/2027                       | 93 165  | 0,00             |                   |
| 632 000   | 2.750%           | Visa Inc 15/09/2027                       | 599 142   | 0,01             |                   |
| 1 075 000   | 2.050%           | Visa Inc 15/04/2030                       | 938 443   | 0,01             |                   |
| 80 000  | 1.100%           | Visa Inc 15/02/2031                       | 63 878  | 0,00             |                   |
| 1 875 000   | 4.150%           | Visa Inc 14/12/2035                       | 1 846 781   | 0,03             |                   |
| 305 000   | 2.700%           | Visa Inc 15/04/2040                       | 241 206   | 0,00             |                   |
| 4 733 000   | 4.300%           | Visa Inc 14/12/2045                       | 4 561 902   | 0,07             |                   |
| 1 785 000   | 3.650%           | Visa Inc 15/09/2047                       | 1 562 964   | 0,02             |                   |
| 1 930 000   | 2.000%           | Visa Inc 15/08/2050                       | 1 218 853   | 0,02             |                   |
| 2 754 000   | 4.125%           | Vodafone Group PLC 30/05/2025             | 2 723 155   | 0,04             |                   |
| 6 144 000   | 4.375%           | Vodafone Group PLC 30/05/2028             | 6 160 343   | 0,09             |                   |
| 1 435 000   | 7.875%           | Vodafone Group PLC 15/02/2030             | 1 675 779   | 0,02             |                   |
| 262 000   | 6.250%           | Vodafone Group PLC 30/11/2032             | 284 595   | 0,00             |                   |
| 16 461 000  | 6.150%           | Vodafone Group PLC 27/02/2037             | 17 629 402  | 0,26             |                   |
| 8 187 000   | 5.000%           | Vodafone Group PLC 30/05/2038             | 7 945 238   | 0,12             |                   |
| 17 603 000  | 4.375%           | Vodafone Group PLC 19/02/2043             | 14 921 359  | 0,22             |                   |
| 5 845 000   | 5.500%           | Vodafone Group PLC 30/05/2048             | 5 640 367   | 0,08             |                   |
| 1 990 000   | 4.875%           | Vodafone Group PLC 19/06/2049             | 1 797 905   | 0,03             |                   |



## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 4 305 000 4.250% Vodafone Group PLC 17/09/2050                          | 3 519 294        | 0,05              |
| 1 050 000 5.625% Vodafone Group PLC 10/02/2053                          | 1 038 681        | 0,02              |
| 4 930 000 5.125% Vodafone Group PLC 19/06/2059                          | 4 494 237        | 0,07              |
| 750 000 5.750% Vodafone Group PLC 10/02/2063                            | 743 243          | 0,01              |
| 1 050 000 3.500% Vomado Realty LP 15/01/2025                            | 948 329          | 0,01              |
| 1 500 000 2.150% Vomado Realty LP 01/06/2026                            | 1 203 945        | 0,02              |
| 1 000 000 3.400% Vomado Realty LP 01/06/2031                            | 691 980          | 0,01              |
| 1 352 000 3.300% Walmart Inc 22/04/2024                                 | 1 339 372        | 0,02              |
| 883 000 2.850% Walmart Inc 08/07/2024                                   | 864 263          | 0,01              |
| 275 000 2.650% Walmart Inc 15/12/2024                                   | 267 317          | 0,00              |
| 810 000 3.550% Walmart Inc 26/06/2025                                   | 802 038          | 0,01              |
| 1 950 000 3.900% Walmart Inc 09/09/2025                                 | 1 945 378        | 0,03              |
| 1 749 000 3.050% Walmart Inc 08/07/2026                                 | 1 695 096        | 0,02              |
| 2 830 000 1.050% Walmart Inc 17/09/2026                                 | 2 551 415        | 0,04              |
| 2 590 000 3.950% Walmart Inc 09/09/2027                                 | 2 589 119        | 0,04              |
| 2 215 000 3.700% Walmart Inc 26/06/2028                                 | 2 194 201        | 0,03              |
| 1 600 000 1.500% Walmart Inc 22/09/2028                                 | 1 404 240        | 0,02              |
| 1 574 000 3.250% Walmart Inc 08/07/2029                                 | 1 501 958        | 0,02              |
| 3 000 2.375% Walmart Inc 24/09/2029                                     | 2 689            | 0,00              |
| 2 200 000 1.800% Walmart Inc 22/09/2031                                 | 1 860 474        | 0,03              |
| 1 825 000 4.150% Walmart Inc 09/09/2032                                 | 1 838 669        | 0,03              |
| 680 000 5.250% Walmart Inc 01/09/2035                                   | 744 709          | 0,01              |
| 81 000 5.000% Walmart Inc 25/10/2040                                    | 84 598           | 0,00              |
| 420 000 5.625% Walmart Inc 15/04/2041                                   | 476 393          | 0,01              |
| 1 500 000 2.500% Walmart Inc 22/09/2041                                 | 1 137 030        | 0,02              |
| 500 000 4.300% Walmart Inc 22/04/2044                                   | 486 695          | 0,01              |
| 600 000 3.625% Walmart Inc 15/12/2047                                   | 516 414          | 0,01              |
| 2 460 000 4.050% Walmart Inc 29/06/2048                                 | 2 288 046        | 0,03              |
| 2 371 000 2.950% Walmart Inc 24/09/2049                                 | 1 803 122        | 0,03              |
| 2 000 000 2.650% Walmart Inc 22/09/2051                                 | 1 442 580        | 0,02              |
| 1 250 000 4.500% Walmart Inc 09/09/2052                                 | 1 249 113        | 0,02              |
| 500 000 1.750% Walt Disney Co 30/08/2024                                | 481 205          | 0,01              |
| 2 275 000 3.350% Walt Disney Co 24/03/2025                              | 2 235 005        | 0,03              |
| 2 050 000 1.750% Walt Disney Co 13/01/2026                              | 1 920 993        | 0,03              |
| 1 550 000 2.000% Walt Disney Co 01/09/2029                              | 1 344 470        | 0,02              |
| 3 550 000 2.650% Walt Disney Co 13/01/2031                              | 3 133 052        | 0,05              |
| 1 620 000 6.650% Walt Disney Co 15/11/2037                              | 1 920 461        | 0,03              |
| 4 300 000 3.500% Walt Disney Co 13/05/2040                              | 3 647 389        | 0,05              |
| 2 000 000 4.625% Waste Management Inc 15/02/2030                        | 1 996 760        | 0,03              |
| 4 015 000 4.000% Welltower OP LLC 01/06/2025                            | 3 892 261        | 0,06              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 31 000 4.250% Welltower OP LLC 01/04/2026                               | 30 393           | 0,00              |
| 400 000 2.700% Welltower OP LLC 15/02/2027                              | 364 196          | 0,01              |
| 1 324 000 4.250% Welltower OP LLC 15/04/2028                            | 1 266 287        | 0,02              |
| 1 640 000 4.125% Welltower OP LLC 15/03/2029                            | 1 529 070        | 0,02              |
| 1 768 000 3.100% Welltower OP LLC 15/01/2030                            | 1 541 378        | 0,02              |
| 500 000 2.750% Welltower OP LLC 15/01/2031                              | 414 575          | 0,01              |
| 541 000 2.800% Welltower OP LLC 01/06/2031                              | 449 631          | 0,01              |
| 329 000 2.750% Welltower OP LLC 15/01/2032                              | 269 589          | 0,00              |
| 825 000 6.500% Welltower OP LLC 15/03/2041                              | 860 162          | 0,01              |
| 1 000 000 4.950% Welltower OP LLC 01/09/2048                            | 860 500          | 0,01              |
| 3 080 000 4.750% Western Digital Corp 15/02/2026                        | 2 966 656        | 0,04              |
| 600 000 2.850% Western Digital Corp 01/02/2029                          | 488 508          | 0,01              |
| 770 000 5.350% Westpac Banking Corp 18/10/2024                          | 776 137          | 0,01              |
| 1 423 000 2.350% Westpac Banking Corp 19/02/2025                        | 1 363 177        | 0,02              |
| 2 000 000 3.735% Westpac Banking Corp 26/08/2025                        | 1 956 540        | 0,03              |
| 2 973 000 2.850% Westpac Banking Corp 13/05/2026                        | 2 817 690        | 0,04              |
| 550 000 1.150% Westpac Banking Corp 03/06/2026                          | 493 306          | 0,01              |
| 1 125 000 2.700% Westpac Banking Corp 19/08/2026                        | 1 056 656        | 0,02              |
| 2 080 000 3.350% Westpac Banking Corp 08/03/2027                        | 1 987 003        | 0,03              |
| 2 000 000 4.043% Westpac Banking Corp 26/08/2027                        | 1 962 440        | 0,03              |
| 1 000 000 5.457% Westpac Banking Corp 18/11/2027                        | 1 039 490        | 0,02              |
| 913 000 3.400% Westpac Banking Corp 25/01/2028                          | 867 642          | 0,01              |
| 1 500 000 1.953% Westpac Banking Corp 20/11/2028                        | 1 306 245        | 0,02              |
| 586 000 2.650% Westpac Banking Corp 16/01/2030                          | 522 513          | 0,01              |
| 2 710 000 2.894% Westpac Banking Corp 04/02/2030                        | 2 544 663        | 0,04              |
| 1 450 000 2.150% Westpac Banking Corp 03/06/2031                        | 1 224 163        | 0,02              |
| 23 012 000 4.322% Westpac Banking Corp 23/11/2031                       | 21 845 061       | 0,32              |
| 1 851 000 4.110% Westpac Banking Corp 24/07/2034                        | 1 655 257        | 0,02              |
| 4 230 000 2.668% Westpac Banking Corp 15/11/2035                        | 3 299 992        | 0,05              |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation   | Investissement                                 | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation   | Investissement                                 | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|--|------------------|-------------------|---|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |  |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b>       |  |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |  |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 98,58 % (mars 2022 : 99,08 %) (suite)</b> |  |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |  |                  |                   | <b>Dollar américain – 98,58 % (suite)</b>                               |  |                  |                   |
| 4 540 000   | 3.020% Westpac Banking Corp 18/11/2036         | 3 547 601        | 0,05              | 50 000  | 6.375% Wisconsin Power and Light Co 15/08/2037 | 54 942           | 0,00              |
| 881 000   | 4.421% Westpac Banking Corp 24/07/2039         | 739 987          | 0,01              | 925 000   | 3.500% Workday Inc 01/04/2027                  | 885 530          | 0,01              |
| 1 509 000   | 2.963% Westpac Banking Corp 16/11/2040         | 1 026 482        | 0,02              | 300 000   | 3.800% Workday Inc 01/04/2032                  | 274 629          | 0,00              |
| 420 000   | 3.133% Westpac Banking Corp 18/11/2041         | 288 254          | 0,00              | 1 764 000   | 3.750% WPP Finance 2010 19/09/2024             | 1 719 706        | 0,03              |
| 84 000  | 6.950% Weyerhaeuser Co 01/10/2027              | 90 137           | 0,00              | 1 000 000   | 4.000% WRKCo Inc 15/03/2028                    | 953 710          | 0,01              |
| 1 722 000   | 4.000% Weyerhaeuser Co 15/11/2029              | 1 623 502        | 0,02              | 1 050 000   | 4.900% WRKCo Inc 15/03/2029                    | 1 032 822        | 0,02              |
| 420 000   | 4.000% Weyerhaeuser Co 15/04/2030              | 393 162          | 0,01              | 1 000 000   | 4.200% WRKCo Inc 01/06/2032                    | 923 790          | 0,01              |
| 3 345 000   | 7.375% Weyerhaeuser Co 15/03/2032              | 3 837 618        | 0,06              | 50 000  | 3.000% WRKCo Inc 15/06/2033                    | 41 011           | 0,00              |
| 50 000  | 4.750% Whirlpool Corp 26/02/2029               | 49 521           | 0,00              | 419 000   | 1.850% VVW Grainger Inc 15/02/2025             | 398 331          | 0,01              |
| 3 000 000   | 5.500% Whirlpool Corp 01/03/2033               | 3 018 900        | 0,04              | 1 610 000   | 4.600% VVW Grainger Inc 15/06/2045             | 1 537 566        | 0,02              |
| 75 000  | 4.500% Whirlpool Corp 01/06/2046               | 61 112           | 0,00              | 200 000   | 3.750% VVW Grainger Inc 15/05/2046             | 165 474          | 0,00              |
| 500 000   | 4.550% Williams Cos Inc 24/06/2024             | 496 375          | 0,01              | 350 000   | 4.200% VVW Grainger Inc 15/05/2047             | 310 709          | 0,00              |
| 330 000   | 3.900% Williams Cos Inc 15/01/2025             | 324 086          | 0,00              | 581 000   | 6.500% Wyeth LLC 01/02/2034                    | 671 328          | 0,01              |
| 350 000   | 5.400% Williams Cos Inc 02/03/2026             | 357 004          | 0,01              | 2 615 000   | 5.950% Wyeth LLC 01/04/2037                    | 2 932 304        | 0,04              |
| 799 000   | 3.750% Williams Cos Inc 15/06/2027             | 767 128          | 0,01              | 2 000   | 3.300% Xcel Energy Inc 01/06/2025              | 1 935            | 0,00              |
| 1 000 000   | 4.650% Williams Cos Inc 15/08/2032             | 963 420          | 0,01              | 1 500 000   | 1.750% Xcel Energy Inc 15/03/2027              | 1 342 060        | 0,02              |
| 1 000 000   | 5.650% Williams Cos Inc 15/03/2033             | 1 032 640        | 0,02              | 300 000   | 4.000% Xcel Energy Inc 15/06/2028              | 291 729          | 0,00              |
| 5 560 000   | 6.300% Williams Cos Inc 15/04/2040             | 5 851 789        | 0,09              | 1 000 000   | 2.600% Xcel Energy Inc 01/12/2029              | 874 160          | 0,01              |
| 400 000   | 5.800% Williams Cos Inc 15/11/2043             | 396 240          | 0,01              | 1 200 000   | 3.400% Xcel Energy Inc 01/06/2030              | 1 096 044        | 0,02              |
| 380 000   | 5.400% Williams Cos Inc 04/03/2044             | 356 676          | 0,01              | 500 000   | 2.350% Xcel Energy Inc 15/11/2031              | 408 985          | 0,01              |
| 840 000   | 5.750% Williams Cos Inc 24/06/2044             | 821 411          | 0,01              | 3 165 000   | 4.600% Xcel Energy Inc 01/06/2032              | 3 078 975        | 0,05              |
| 450 000   | 4.900% Williams Cos Inc 15/01/2045             | 396 167          | 0,01              | 700 000   | 6.500% Xcel Energy Inc 01/07/2036              | 762 783          | 0,01              |
| 3 710 000   | 5.100% Williams Cos Inc 15/09/2045             | 3 405 669        | 0,05              | 5 520 000   | 5.250% XLIT Ltd 15/12/2043                     | 5 576 966        | 0,08              |
| 1 000 000   | 4.850% Williams Cos Inc 01/03/2048             | 884 910          | 0,01              | 1 872 000   | 3.250% Xylem Inc/NY 01/11/2026                 | 1 787 273        | 0,03              |
| 325 000   | 5.300% Williams Cos Inc 15/08/2052             | 306 855          | 0,00              | 4 450 000   | 1.950% Xylem Inc/NY 30/01/2028                 | 3 940 341        | 0,06              |
| 1 000 000   | 3.000% Wisconsin Power and Light Co 01/07/2029 | 907 390          | 0,01              | 2 086 000   | 2.250% Xylem Inc/NY 30/01/2031                 | 1 756 349        | 0,03              |
| 2 000 000   | 3.950% Wisconsin Power and Light Co 01/09/2032 | 1 884 400        | 0,03              | 5 787 000   | 4.375% Xylem Inc/NY 01/11/2046                 | 5 056 507        | 0,07              |
| 890 000   | 4.950% Wisconsin Power and Light Co 01/04/2033 | 896 737          | 0,01              |   |  |                  |                   |
| <b>Instruments financiers dérivés – 0,11 % (mars 2022 : (0,01 %))</b>   |  |                  |                   | <b>Total des obligations d'entreprise</b>                               |  |                  |                   |
| <b>Contrats de change à terme – 0,11 % (mars 2022 : (0,01 %))^</b>      |  |                  |                   | <b>6 739 642 855 98,58</b>  |  |                  |                   |
|   |  |                  |                   | <b>Total des valeurs mobilières</b>                                     |  |                  |                   |
|   |  |                  |                   | <b>6 739 642 855 98,58</b>  |  |                  |                   |

| Devise achetée | Devise vendue | Montant acheté | Montant vendu | Date d'échéance | Contrepartie                | Plus-values/ (Moins-values) latentes USD | % du Comp. |
|----------------|---------------|----------------|---------------|-----------------|-----------------------------|--|------------|
| EUR            | USD           | 725 027        | 790 000       | 05/04/2023      | Royal Bank of Canada        | (2 252)                                  | (0,00)     |
| EUR            | USD           | 509 843        | 549 000       | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | 4 949                                    | 0,00       |
| EUR            | USD           | 488 992        | 523 000       | 05/04/2023      | Standard Chartered Bank     | 8 294                                    | 0,00       |
| EUR            | USD           | 594 663        | 633 000       | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | 13 106                                   | 0,00       |
| EUR            | USD           | 71 593 465     | 75 717 750    | 05/04/2023      | Goldman Sachs               | 2 069 197                                | 0,03       |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

Instruments financiers dérivés – 0,11 % (mars 2022 : (0,01 %) (suite)

Contrats de change à terme – 0,11 % (mars 2022 : (0,01 %) (suite)

| Devise achetée  | Devise vendue | Montant acheté | Montant vendu | Date d'échéance | Contrepartie                | Plus-values/<br>(Moins-values)<br>latentes<br>USD | % du<br>Comp. |
|---|---------------|----------------|---------------|-----------------|-----------------------------|---|---------------|
| EUR   | USD           | 71 600 100     | 75 717 750    | 05/04/2023      | UBS AG                      | 2 076 405   | 0,03          |
| EUR   | USD           | 71 607 074     | 75 717 750    | 05/04/2023      | HSBC Bank                   | 2 083 983   | 0,03          |
| EUR   | USD           | 73 400 942     | 77 646 750    | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | 2 104 036   | 0,03          |
| EUR   | USD           | 61 890 843     | 67 355 000    | 04/05/2023      | Merrill Lynch International | (501)   | (0,00)        |
| EUR   | USD           | 61 895 382     | 67 355 000    | 04/05/2023      | Citibank                    | 4 438   | 0,00          |
| EUR   | USD           | 61 896 701     | 67 355 000    | 04/05/2023      | Westpac Banking Corporation | 5 874   | 0,00          |
| EUR   | USD           | 61 902 049     | 67 355 000    | 04/05/2023      | HSBC Bank                   | 11 694  | 0,00          |
| USD   | EUR           | 86 748 000     | 80 182 507    | 05/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (371 017)   | (0,00)        |
| USD   | EUR           | 18 482 000     | 17 335 569    | 05/04/2023      | BNP Paribas                 | (353 252)   | (0,01)        |
| USD   | EUR           | 67 355 000     | 62 004 050    | 05/04/2023      | HSBC Bank                   | (12 961)  | (0,00)        |
| USD   | EUR           | 67 355 000     | 61 997 128    | 05/04/2023      | Citibank                    | (5 439)   | (0,00)        |
| USD   | EUR           | 67 355 000     | 61 992 637    | 05/04/2023      | Merrill Lynch International | (560)   | (0,00)        |
| <b>Plus-values latentes sur contrats de change à terme</b>        |               |                |               |                 |                             | <b>8 381 976</b>                                  | <b>0,12</b>   |
| <b>Moins-values latentes sur contrats de change à terme</b>       |               |                |               |                 |                             | <b>(745 982)</b>                                  | <b>(0,01)</b> |
| <b>Plus-values latentes nettes sur contrats de change à terme</b> |               |                |               |                 |                             | <b>7 635 994</b>                                  | <b>0,11</b>   |
| <b>Total des instruments financiers dérivés</b>                   |               |                |               |                 |                             | <b>7 635 994</b>                                  | <b>0,11</b>   |

|   | Juste valeur<br>USD  | % du<br>Comp. |
|---|----------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | <b>6 747 278 849</b> | <b>98,69</b>  |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,56 %)</b>                               | <b>21 450 005</b>    | <b>0,31</b>   |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : 0,37 %)</b>                                      | <b>68 425 911</b>    | <b>1,00</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>6 837 154 765</b> | <b>100,00</b> |

^ Les contrats à terme sont utilisés à des fins de couverture.

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

|  | % du<br>total<br>des<br>actifs |
|--|--------------------------------|
| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                                   |                                |
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs            | 88,73                          |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé                        | 4,53                           |
| Autres valeurs mobilières du type mentionné dans le Règlement 68(1)(a), (b) et (c) | 3,45                           |
| Instruments financiers dérivés négociés de gré à gré                               | 0,12                           |
| Autres actifs  | 3,17                           |
| <b>Total des actifs</b>  | <b>100,00</b>                  |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD        | 2022<br>USD        |
|---|-------|--------------------|--------------------|
| <b>Actifs circulants</b>  |       |                    |                    |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :            | 1(e)  |                    |                    |
| Valeurs mobilières  |       | 188 411 661        | 135 287 357        |
| Instruments financiers dérivés  |       | 1 636 126          | 3 055              |
|   |       | <b>190 047 787</b> | <b>135 290 412</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie   | 1(f)  | 693 245            | 1 889 033          |
| Créances :  |       |                    |                    |
| Intérêts à recevoir   |       | 3 154 625          | 2 007 786          |
| À recevoir sur cessions d'investissements   |       | 508                | 1 475 990          |
|   |       | <b>193 896 165</b> | <b>140 663 221</b> |
| <b>Passifs circulants</b>   |       |                    |                    |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :           | 1(e)  |                    |                    |
| Instruments financiers dérivés  |       | (246 938)          | -                  |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :  |       |                    |                    |
| Charges à payer   |       | (52 063)           | (34 470)           |
| À payer sur achats d'investissements  |       | (196 620)          | (4 552 502)        |
|   |       | <b>(495 621)</b>   | <b>(4 586 972)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> |       | <b>193 400 544</b> | <b>136 076 249</b> |
|   |       | <b>2023</b>        | <b>2022</b>        |
|   |       | <b>2021</b>        |                    |
| Valeur liquidative par action   |       |                    |                    |
| Catégorie couverte en EUR*  | 5     | 28,37 EUR          | 30,28 EUR          |
| Catégorie non couverte en USD   | 5     | 38,82 USD          | 42,89 USD          |
|   |       |                    | 45,63 USD          |

\* Cette catégorie d'actions a été lancée le 24 mars 2022.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD        | 2022<br>USD         |
|---|-------|--------------------|---------------------|
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 11 553 057         | 8 290 568           |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 9     | (10 788 983)       | (9 321 417)         |
| Produits divers   |       | 9 679              | -                   |
| <b>Total des produits/(charges) d'investissement</b>  |       | <b>773 753</b>     | <b>(1 030 849)</b>  |
| Charges opérationnelles   | 3     | (505 064)          | (479 374)           |
| <b>Bénéfice/(Perte) net(te) pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>                               |       | <b>268 689</b>     | <b>(1 510 223)</b>  |
| <b>Charges financières</b>  |       |                    |                     |
| Charges d'intérêts  |       | (978)              | (17)                |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables   | 7     | (9 403 386)        | (8 512 233)         |
| <b>Perte pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(9 135 675)</b> | <b>(10 022 473)</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement   | 2     | (745)              | -                   |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(9 136 420)</b> | <b>(10 022 473)</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>USD        | 2022<br>USD         |
|---|--------------------|---------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier               | 136 076 249        | 151 265 179         |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(9 136 420)</b> | <b>(10 022 473)</b> |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                    |                     |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 224 616 290        | 74 911 259          |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (158 155 575)      | (80 077 716)        |
| Augmentation/(Diminution) des actifs nets résultant d'opérations sur actions  | 66 460 715         | (5 166 457)         |
| <b>Augmentation/(Diminution) totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>    | <b>57 324 295</b>  | <b>(15 188 930)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>        | <b>193 400 544</b> | <b>136 076 249</b>  |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD         | 2022<br>USD        |
|---|-------|---------------------|--------------------|
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | (9 136 420)         | (10 022 473)       |
| <b>Ajustement pour :</b>  |       |                     |                    |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  |       | (56 004 704)        | 10 861 755         |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés   |       | (1 386 133)         | (3 055)            |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   |       | <b>(66 527 257)</b> | <b>836 227</b>     |
| Variation des montants à recevoir   |       | (1 146 839)         | 90 903             |
| Variation des montants à payer  |       | 17 593              | (4 984)            |
| <b>(Sorties)/Entrées de trésorerie sur opérations</b>   |       | <b>(1 129 246)</b>  | <b>85 919</b>      |
| <b>(Sorties)/Entrées de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  |       | <b>(67 656 503)</b> | <b>922 146</b>     |
| <b>Activités de financement</b>   |       |                     |                    |
| Produits des souscriptions  | 5     | 224 616 290         | 74 911 259         |
| Paievements sur rachats   | 5     | (158 155 575)       | (80 077 716)       |
| <b>Trésorerie nette générée/(utilisée) sur activités de financement</b>   |       | <b>66 460 715</b>   | <b>(5 166 457)</b> |
| <b>Diminution nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>   |       | <b>(1 195 788)</b>  | <b>(4 244 311)</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  |       | 1 889 033           | 6 133 344          |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   |       | <b>693 245</b>      | <b>1 889 033</b>   |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |       |                     |                    |
| Impôts payés  |       | (745)               | -                  |
| Intérêts reçus  |       | 9 261 630           | 9 045 953          |
| Intérêts payés  |       | (978)               | (17)               |
| Distributions payées  |       | (9 403 386)         | (8 512 233)        |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %)</b>                              |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %)</b>                        |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 97,42 %</b>  |                  |                   |
| 99 000 6.000% Academy Ltd 15/11/2027   | 96 921           | 0,05              |
| 100 000 4.250% ACCO Brands Corp 15/03/2029   | 86 354           | 0,04              |
| 104 000 7.000% Adient Global Holdings 15/04/2028                                       | 107 113          | 0,06              |
| 94 000 8.250% Adient Global Holdings 15/04/2031  | 97 321           | 0,05              |
| 100 000 5.500% Adtalem Global Education Inc 01/03/2028                                 | 94 854           | 0,05              |
| 180 000 5.000% Advanced Drainage Systems Inc 30/09/2027                                | 171 358          | 0,09              |
| 103 000 6.375% Advanced Drainage Systems Inc 15/06/2030                                | 101 418          | 0,05              |
| 200 000 5.125% AECOM 15/03/2027  | 196 166          | 0,10              |
| 135 000 8.625% AG TTMT Escrow Issuer LLC 30/09/2027                                    | 135 842          | 0,07              |
| 745 000 3.875% Air Canada 15/08/2026   | 676 758          | 0,35              |
| 170 000 10.500% Air Canada 2020-1 Class C Pass Through Trust 15/07/2026                | 180 163          | 0,09              |
| 200 000 4.750% Algonquin Power & Utilities Corp 18/01/2082                             | 160 080          | 0,08              |
| 50 000 7.250% Allegiant Travel Co 15/08/2027   | 49 321           | 0,03              |
| 188 000 8.750% Alteryx Inc 15/03/2028  | 189 607          | 0,10              |
| 41 320 4.000% American Airlines 2013-1 Class A Pass Through Trust 15/01/2027           | 36 945           | 0,02              |
| 115 146 3.700% American Airlines 2014-1 Class A Pass Through Trust 01/04/2028          | 102 793          | 0,05              |
| 46 935 3.375% American Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust 01/11/2028           | 40 605           | 0,02              |
| 129 853 3.250% American Airlines 2016-3 Class A Pass Through Trust 15/04/2030          | 109 511          | 0,06              |
| 400 000 3.750% American Airlines Group Inc 01/03/2025                                  | 366 716          | 0,19              |
| 690 000 11.750% American Airlines Inc 15/07/2025                                       | 753 797          | 0,39              |
| 160 000 7.250% American Airlines Inc 15/02/2028  | 155 600          | 0,08              |
| 200 000 5.500% American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd 20/04/2026             | 197 078          | 0,10              |
| 550 000 5.750% American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd 20/04/2029             | 527 873          | 0,27              |
| 204 000 6.250% American Axle & Manufacturing Inc 15/03/2026                            | 196 705          | 0,10              |
| 100 000 6.500% American Axle & Manufacturing Inc 01/04/2027                            | 92 366           | 0,05              |
| 143 000 5.000% American Axle & Manufacturing Inc 01/10/2029                            | 120 949          | 0,06              |
| 100 000 7.875% Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp 15/05/2026 | 102 148          | 0,05              |
| 450 000 5.750% Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp 01/03/2027 | 439 524          | 0,23              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %)</b>   |                  |                   |
| <b>(suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>                               |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 97,42 % (suite)</b>   |                  |                   |
| 25 000 7.625% Antero Resources Corp 01/02/2029  | 25 574           | 0,01              |
| 200 000 5.375% Antero Resources Corp 01/03/2030   | 185 730          | 0,10              |
| 200 000 7.750% Apache Corp 15/12/2029   | 210 096          | 0,11              |
| 80 000 6.000% Apache Corp 15/01/2037  | 74 290           | 0,04              |
| 300 000 5.100% Apache Corp 01/09/2040   | 254 190          | 0,13              |
| 310 000 4.250% Apache Corp 15/01/2044   | 220 751          | 0,11              |
| 50 000 5.350% Apache Corp 01/07/2049  | 39 048           | 0,02              |
| 200 000 4.625% Apollo Commercial Real Estate Finance Inc 15/06/2029                                   | 140 636          | 0,07              |
| 100 000 6.250% Archrock Partners LP / Archrock Partners Finance Corp 01/04/2028                       | 95 992           | 0,05              |
| 1 350 000 6.000% Arconic Corp 15/05/2025  | 1 349 770        | 0,70              |
| 1 670 000 6.125% Arconic Corp 15/02/2028  | 1 646 520        | 0,85              |
| 200 000 6.000% Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance PLC 15/06/2027 | 198 194          | 0,10              |
| 200 000 4.000% Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance PLC 01/09/2029 | 157 306          | 0,08              |
| 200 000 3.375% Ashland LLC 01/09/2031   | 165 352          | 0,09              |
| 50 000 4.875% ATI Inc 01/10/2029  | 45 630           | 0,02              |
| 100 000 5.125% ATI Inc 01/10/2031   | 90 994           | 0,05              |
| 485 000 4.625% Avantor Funding Inc 15/07/2028   | 460 449          | 0,24              |
| 210 000 7.125% Avient Corp 01/08/2030   | 216 567          | 0,11              |
| 200 000 4.750% Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc 01/04/2028                        | 181 932          | 0,09              |
| 100 000 8.450% Avon Products Inc 15/03/2043   | 100 962          | 0,05              |
| 100 000 3.375% Axalta Coating Systems LLC 15/02/2029  | 86 596           | 0,04              |
| 150 000 5.250% B&G Foods Inc 01/04/2025   | 139 568          | 0,07              |
| 100 000 5.250% B&G Foods Inc 15/09/2027   | 86 026           | 0,04              |
| 524 000 5.250% Ball Corp 01/07/2025   | 523 219          | 0,27              |
| 205 000 6.875% Ball Corp 15/03/2028   | 212 148          | 0,11              |
| 2 380 000 2.875% Ball Corp 15/08/2030   | 1 995 701        | 1,03              |
| 979 000 3.125% Ball Corp 15/09/2031   | 810 397          | 0,42              |
| 100 000 6.950% Bath & Body Works Inc 01/03/2033   | 88 498           | 0,05              |
| 70 000 6.750% Bath & Body Works Inc 01/07/2036  | 62 513           | 0,03              |
| 480 000 8.500% Bausch Health Americas Inc 31/01/2027  | 217 853          | 0,11              |
| 410 000 5.500% Bausch Health Cos Inc 01/11/2025   | 341 956          | 0,18              |
| 385 000 6.125% Bausch Health Cos Inc 01/02/2027   | 249 449          | 0,13              |



## SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>                                      |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 97,42 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 100 000 4.875% Bausch Health Cos Inc 01/06/2028  | 59 426           | 0,03              |
| 850 000 7.250% Bausch Health Cos Inc 30/05/2029  | 327 590          | 0,17              |
| 1 100 000 14.000% Bausch Health Cos Inc 15/10/2030   | 632 533          | 0,33              |
| 1 000 000 8.750% Baytex Energy Corp 01/04/2027   | 1 022 880        | 0,53              |
| 340 000 4.500% Berry Global Inc 15/02/2026   | 331 024          | 0,17              |
| 280 000 5.625% Berry Global Inc 15/07/2027   | 275 741          | 0,14              |
| 670 000 7.875% Bombardier Inc 15/04/2027   | 679 367          | 0,35              |
| 135 000 7.500% Bombardier Inc 01/02/2029   | 137 932          | 0,07              |
| 230 000 7.125% Boxer Parent Co Inc 02/10/2025  | 231 387          | 0,12              |
| 300 000 4.750% Boyd Gaming Corp 01/12/2027   | 287 628          | 0,15              |
| 45 000 4.750% Boyne USA Inc 15/05/2029   | 40 069           | 0,02              |
| 200 000 4.875% British Telecommunications PLC 23/11/2081   | 158 788          | 0,08              |
| 721 000 5.750% Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GCSI Sellco LL 15/05/2026   | 644 466          | 0,33              |
| 1 568 000 4.500% Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GCSI Sellco LL 01/04/2027 | 1 258 681        | 0,65              |
| 300 000 6.250% Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC 15/09/2027              | 266 097          | 0,14              |
| 1 555 000 6.250% Caesars Entertainment Inc 01/07/2025  | 1 555 482        | 0,80              |
| 1 120 000 8.125% Caesars Entertainment Inc 01/07/2027  | 1 142 870        | 0,59              |
| 280 000 4.625% Caesars Entertainment Inc 15/10/2029  | 245 622          | 0,13              |
| 1 000 000 7.000% Caesars Entertainment Inc 15/02/2030  | 1 017 300        | 0,53              |
| 1 720 000 5.750% Caesars Resort Collection LLC / CRC Finco Inc 01/07/2025                                    | 1 727 481        | 0,90              |
| 1 350 000 7.125% California Resources Corp 01/02/2026  | 1 364 931        | 0,71              |
| 600 000 8.000% Callon Petroleum Co 01/08/2028  | 594 564          | 0,31              |
| 440 000 7.500% Callon Petroleum Co 15/06/2030  | 413 367          | 0,21              |
| 200 000 10.500% Carnival Corp 01/02/2026   | 208 104          | 0,11              |
| 1 400 000 7.625% Carnival Corp 01/03/2026  | 1 277 318        | 0,66              |
| 597 000 5.750% Carnival Corp 01/03/2027  | 490 233          | 0,25              |
| 600 000 6.650% Carnival Corp 15/01/2028  | 456 192          | 0,24              |
| 250 000 4.000% Carnival Corp 01/08/2028  | 215 340          | 0,11              |
| 2 025 000 6.000% Carnival Corp 01/05/2029  | 1 610 563        | 0,83              |
| 850 000 10.500% Carnival Corp 01/06/2030   | 816 127          | 0,42              |
| 220 000 10.375% Carnival Holdings Bermuda Ltd 01/05/2028   | 236 564          | 0,12              |
| 200 000 7.875% Carnival PLC 01/06/2027   | 196 632          | 0,10              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 97,42 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 233 000 5.125% Cascades Inc/Cascades USA Inc 15/01/2026                 | 220 329          | 0,11              |
| 50 000 5.000% Catalent Pharma Solutions Inc 15/07/2027                  | 48 828           | 0,03              |
| 200 000 3.875% Cellnex Finance Co SA 07/07/2041                         | 147 318          | 0,08              |
| 50 000 3.375% Centene Corp 15/02/2030                                   | 43 789           | 0,02              |
| 640 000 8.750% CGG SA 01/04/2027  | 540 832          | 0,28              |
| 350 000 3.750% Charles River Laboratories International Inc 15/03/2029  | 311 356          | 0,16              |
| 154 000 7.500% Chart Industries Inc 01/01/2030                          | 159 116          | 0,08              |
| 62 000 9.500% Chart Industries Inc 01/01/2031                           | 65 430           | 0,03              |
| 400 000 5.375% Chemours Co 15/05/2027                                   | 370 740          | 0,19              |
| 1 566 000 5.750% Chemours Co 15/11/2028                                 | 1 406 894        | 0,73              |
| 1 420 000 4.625% Chemours Co 15/11/2029                                 | 1 175 888        | 0,61              |
| 400 000 5.500% Chesapeake Energy Corp 01/02/2026                        | 393 504          | 0,20              |
| 110 000 8.000% CHS/Community Health Systems Inc 15/03/2026              | 106 358          | 0,06              |
| 3 000 000 3.875% Clarivate Science Holdings Corp 01/07/2028             | 2 678 100        | 1,38              |
| 380 000 4.875% Clarivate Science Holdings Corp 01/07/2029               | 343 600          | 0,18              |
| 200 000 4.875% Clean Harbors Inc 15/07/2027                             | 194 086          | 0,10              |
| 105 000 6.375% Clean Harbors Inc 01/02/2031                             | 107 138          | 0,06              |
| 497 000 5.125% Clear Channel Outdoor Holdings Inc 15/08/2027            | 445 913          | 0,23              |
| 260 000 7.500% Clear Channel Outdoor Holdings Inc 01/06/2029            | 185 294          | 0,10              |
| 100 000 4.750% Clearwater Paper Corp 15/08/2028                         | 89 825           | 0,05              |
| 101 000 6.750% Cleveland-Cliffs Inc 15/03/2026                          | 102 758          | 0,05              |
| 76 000 5.875% Cleveland-Cliffs Inc 01/06/2027                           | 75 281           | 0,04              |
| 75 000 4.875% Cleveland-Cliffs Inc 01/03/2031                           | 68 640           | 0,04              |
| 80 000 6.250% Cleveland-Cliffs Inc 01/10/2040                           | 68 998           | 0,04              |
| 835 000 4.750% CNX Midstream Partners LP 15/04/2030                     | 717 866          | 0,37              |
| 10 000 7.250% CNX Resources Corp 14/03/2027                             | 10 071           | 0,01              |
| 60 000 6.000% CNX Resources Corp 15/01/2029                             | 56 385           | 0,03              |
| 165 000 7.375% CNX Resources Corp 15/01/2031                            | 162 513          | 0,08              |
| 655 000 5.125% Coeur Mining Inc 15/02/2029                              | 553 462          | 0,29              |
| 200 000 5.000% Coherent Corp 15/12/2029                                 | 181 486          | 0,09              |
| 40 000 4.125% Commercial Metals Co 15/01/2030                           | 35 529           | 0,02              |
| 35 000 4.375% Commercial Metals Co 15/03/2032                           | 30 347           | 0,02              |
| 250 000 8.125% Commerzbank AG 19/09/2023                                | 246 397          | 0,13              |
| 1 132 000 6.000% CommScope Inc 01/03/2026                               | 1 091 293        | 0,56              |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>                            |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>                    |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>                      |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>              |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 97,42 % (suite)</b>  |                  |                   | <b>Dollar américain – 97,42 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 810 000 8.250% CommScope Inc 01/03/2027  | 663 568          | 0,34              | 1 450 000 6.625% Diamond Sports Group LLC / Diamond Sports Finance Co 15/08/2027     | 17 676           | 0,01              |
| 1 529 000 7.125% CommScope Inc 01/07/2028  | 1 127 393        | 0,58              | 1 369 000 9.375% Diebold Nixdorf Inc 15/07/2025                                      | 704 282          | 0,36              |
| 640 000 4.750% CommScope Inc 01/09/2029  | 533 274          | 0,28              | 544 193 8.500% Diebold Nixdorf Inc 15/10/2026  | 136 288          | 0,07              |
| 553 000 6.000% CommScope Technologies LLC 15/06/2025   | 521 573          | 0,27              | 2 120 000 5.875% Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc 15/08/2027 | 1 920 232        | 0,99              |
| 126 000 5.000% CommScope Technologies LLC 15/03/2027   | 92 042           | 0,05              | 75 000 5.250% DISH DBS Corp 01/12/2026   | 59 920           | 0,03              |
| 130 000 6.750% Compass Minerals International Inc 01/12/2027                                 | 124 311          | 0,06              | 1 250 000 9.750% Diversified Healthcare Trust 15/06/2025                             | 1 209 325        | 0,63              |
| 300 000 6.750% Comstock Resources Inc 01/03/2029   | 273 138          | 0,14              | 600 000 4.750% Diversified Healthcare Trust 15/02/2028                               | 404 922          | 0,21              |
| 730 000 5.875% Constellation SE 15/02/2026   | 730 394          | 0,38              | 50 000 6.750% Domtar Corp 01/10/2028   | 44 515           | 0,02              |
| 500 000 5.625% Constellation SE 15/06/2028   | 475 900          | 0,25              | 400 000 6.625% Drax Finco PLC 01/11/2025   | 393 720          | 0,20              |
| 995 000 3.750% Constellation SE 15/04/2029   | 862 556          | 0,45              | 100 000 8.151% Dresdner Funding Trust I 30/06/2031                                   | 102 155          | 0,05              |
| 117 450 13.500% Cooper-Standard Automotive Inc 31/03/2027                                    | 122 443          | 0,06              | 300 000 4.375% DT Midstream Inc 15/06/2031   | 260 745          | 0,13              |
| 81 000 5.625% Cooper-Standard Automotive Inc 15/05/2027                                      | 46 723           | 0,02              | 60 000 7.875% Eco Material Technologies Inc 31/01/2027                               | 57 120           | 0,03              |
| 400 000 5.000% Coty Inc 15/04/2026   | 387 452          | 0,20              | 280 000 5.500% Edgewell Personal Care Co 01/06/2028                                  | 268 120          | 0,14              |
| 100 000 6.500% Coty Inc 15/04/2026   | 99 802           | 0,05              | 100 000 4.125% Elastic NV 15/07/2029   | 85 349           | 0,04              |
| 335 000 4.875% Covanta Holding Corp 01/12/2029   | 295 989          | 0,15              | 500 000 7.995% Embarq Corp 01/06/2036  | 209 585          | 0,11              |
| 526 000 5.000% Covanta Holding Corp 01/09/2030   | 452 965          | 0,23              | 55 000 5.000% Embecta Corp 15/02/2030  | 47 350           | 0,02              |
| 100 000 5.625% Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp 01/05/2027 | 96 382           | 0,05              | 120 000 3.875% Emergent BioSolutions Inc 15/08/2028                                  | 58 276           | 0,03              |
| 192 000 8.000% Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp 01/04/2029 | 195 723          | 0,10              | 250 000 4.375% Energizer Holdings Inc 31/03/2029                                     | 219 820          | 0,11              |
| 145 000 7.375% Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp 01/02/2031 | 145 010          | 0,08              | 50 000 4.375% EnerSys 15/12/2027   | 46 352           | 0,02              |
| 100 000 4.250% Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp V 30/09/2026                 | 95 906           | 0,05              | 90 000 6.500% EnLink Midstream LLC 01/09/2030  | 91 004           | 0,05              |
| 130 000 4.750% Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp VI 01/02/2026                | 127 249          | 0,07              | 100 000 8.500% Enova International Inc 01/09/2024                                    | 98 509           | 0,05              |
| 780 000 7.375% Crown Cork & Seal Co Inc 15/12/2026   | 824 062          | 0,43              | 825 000 8.500% Enova International Inc 15/09/2025                                    | 781 902          | 0,40              |
| 200 000 6.750% Cushman & Wakefield US Borrower LLC 15/05/2028                                | 179 900          | 0,09              | 125 000 5.950% Entegris Escrow Corp 15/06/2030                                       | 121 130          | 0,06              |
| 7 000 5.375% Dana Inc 15/11/2027   | 6 616            | 0,00              | 100 000 4.375% Entegris Inc 15/04/2028   | 90 715           | 0,05              |
| 150 000 4.250% Dana Inc 01/09/2030   | 122 336          | 0,06              | 147 000 6.000% EQM Midstream Partners LP 01/07/2025                                  | 145 409          | 0,08              |
| 160 000 5.250% Darling Ingredients Inc 15/04/2027  | 156 771          | 0,08              | 250 000 7.500% EQM Midstream Partners LP 01/06/2027                                  | 250 915          | 0,13              |
| 300 000 4.625% DaVita Inc 01/06/2030   | 255 990          | 0,13              | 200 000 6.500% EQM Midstream Partners LP 01/07/2027                                  | 193 674          | 0,10              |
| 225 000 3.750% DaVita Inc 15/02/2031   | 177 291          | 0,09              | 300 000 5.500% EQM Midstream Partners LP 15/07/2028                                  | 272 355          | 0,14              |
| 300 000 2.900% Delta Air Lines Inc 28/10/2024  | 287 064          | 0,15              | 85 000 7.500% EQM Midstream Partners LP 01/06/2030                                   | 82 317           | 0,04              |
| 170 000 7.375% Delta Air Lines Inc 15/01/2026  | 176 970          | 0,09              | 100 000 6.500% EQM Midstream Partners LP 15/07/2048                                  | 77 113           | 0,04              |
| 550 000 5.375% Diamond Sports Group LLC / Diamond Sports Finance Co 15/08/2026               | 29 755           | 0,02              | 150 000 5.000% Everi Holdings Inc 15/07/2029   | 134 505          | 0,07              |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 97,42 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 250 000 4.150% FirstEnergy Corp 15/07/2027                              | 239 535          | 0,12              |
| 30 000 2.650% FirstEnergy Corp 01/03/2030                               | 25 664           | 0,01              |
| 50 000 2.250% FirstEnergy Corp 01/09/2030                               | 41 297           | 0,02              |
| 245 000 7.375% FirstEnergy Corp 15/11/2031                              | 276 887          | 0,14              |
| 280 000 5.350% FirstEnergy Corp 15/07/2047                              | 251 423          | 0,13              |
| 150 000 3.400% FirstEnergy Corp 01/03/2050                              | 104 480          | 0,05              |
| 910 000 4.500% FMG Resources August 2006 Pty Ltd 15/09/2027             | 873 764          | 0,45              |
| 275 000 5.875% FMG Resources August 2006 Pty Ltd 15/04/2030             | 265 980          | 0,14              |
| 210 000 4.375% FMG Resources August 2006 Pty Ltd 01/04/2031             | 179 502          | 0,09              |
| 200 000 6.125% FMG Resources August 2006 Pty Ltd 15/04/2032             | 191 774          | 0,10              |
| 200 000 6.375% Ford Motor Co 01/02/2029                                 | 195 540          | 0,10              |
| 50 000 7.450% Ford Motor Co 16/07/2031                                  | 52 462           | 0,03              |
| 700 000 3.250% Ford Motor Co 12/02/2032                                 | 548 037          | 0,28              |
| 905 000 6.100% Ford Motor Co 19/08/2032                                 | 874 330          | 0,45              |
| 950 000 5.291% Ford Motor Co 08/12/2046                                 | 770 668          | 0,40              |
| 100 000 5.584% Ford Motor Credit Co LLC 18/03/2024                      | 99 028           | 0,05              |
| 250 000 4.063% Ford Motor Credit Co LLC 01/11/2024                      | 241 377          | 0,12              |
| 200 000 2.300% Ford Motor Credit Co LLC 10/02/2025                      | 185 464          | 0,10              |
| 200 000 4.687% Ford Motor Credit Co LLC 09/06/2025                      | 192 424          | 0,10              |
| 225 000 5.125% Ford Motor Credit Co LLC 16/06/2025                      | 220 153          | 0,11              |
| 400 000 4.134% Ford Motor Credit Co LLC 04/08/2025                      | 381 384          | 0,20              |
| 240 000 3.375% Ford Motor Credit Co LLC 13/11/2025                      | 222 641          | 0,12              |
| 330 000 4.389% Ford Motor Credit Co LLC 08/01/2026                      | 313 051          | 0,16              |
| 200 000 6.950% Ford Motor Credit Co LLC 06/03/2026                      | 203 064          | 0,11              |
| 300 000 2.700% Ford Motor Credit Co LLC 10/08/2026                      | 267 036          | 0,14              |
| 300 000 4.271% Ford Motor Credit Co LLC 09/01/2027                      | 279 480          | 0,14              |
| 750 000 4.125% Ford Motor Credit Co LLC 17/08/2027                      | 686 775          | 0,36              |
| 800 000 3.815% Ford Motor Credit Co LLC 02/11/2027                      | 716 600          | 0,37              |
| 200 000 7.350% Ford Motor Credit Co LLC 04/11/2027                      | 206 312          | 0,11              |
| 200 000 2.900% Ford Motor Credit Co LLC 10/02/2029                      | 165 656          | 0,09              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>         |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>   |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 97,42 % (suite)</b>                                 |                  |                   |
| 380 000 5.113% Ford Motor Credit Co LLC 03/05/2029                        | 356 577          | 0,18              |
| 270 000 7.350% Ford Motor Credit Co LLC 06/03/2030                        | 277 889          | 0,14              |
| 250 000 4.000% Ford Motor Credit Co LLC 13/11/2030                        | 213 297          | 0,11              |
| 30 000 3.625% Ford Motor Credit Co LLC 17/06/2031                         | 24 711           | 0,01              |
| 160 000 3.625% Gap Inc 01/10/2029   | 111 850          | 0,06              |
| 30 000 3.875% Gap Inc 01/10/2031  | 20 359           | 0,01              |
| 160 000 7.750% Garda World Security Corp 15/02/2028                       | 157 714          | 0,08              |
| 750 000 8.625% Garden Spinco Corp 20/07/2030                              | 811 020          | 0,42              |
| 1 000 000 3.625% Gartner Inc 15/06/2029                                   | 893 230          | 0,46              |
| 225 000 6.750% Gen Digital Inc 30/09/2027                                 | 226 276          | 0,12              |
| 200 000 7.125% Gen Digital Inc 30/09/2030                                 | 199 014          | 0,10              |
| 400 000 6.500% Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 01/10/2025 | 388 608          | 0,20              |
| 185 000 8.000% Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 15/01/2027 | 182 549          | 0,09              |
| 100 000 8.875% Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 15/04/2030 | 101 675          | 0,05              |
| 22 000 10.500% GEO Group Inc 30/06/2028                                   | 22 286           | 0,01              |
| 150 000 4.000% GFL Environmental Inc 01/08/2028                           | 136 272          | 0,07              |
| 220 000 3.500% GFL Environmental Inc 01/09/2028                           | 198 887          | 0,10              |
| 50 000 4.750% GFL Environmental Inc 15/06/2029                            | 46 270           | 0,02              |
| 80 000 4.375% GFL Environmental Inc 15/08/2029                            | 71 710           | 0,04              |
| 100 000 4.750% Glatfelter Corp 15/11/2029                                 | 66 674           | 0,03              |
| 250 000 3.500% Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc 01/03/2029   | 216 162          | 0,11              |
| 253 000 9.500% Goodyear Tire & Rubber Co 31/05/2025                       | 260 653          | 0,13              |
| 1 100 000 5.000% Goodyear Tire & Rubber Co 31/05/2026                     | 1 063 370        | 0,55              |
| 150 000 4.875% Goodyear Tire & Rubber Co 15/03/2027                       | 141 873          | 0,07              |
| 800 000 5.250% Goodyear Tire & Rubber Co 15/07/2031                       | 688 352          | 0,36              |
| 639 000 5.625% Goodyear Tire & Rubber Co 30/04/2033                       | 552 556          | 0,29              |
| 30 000 4.750% Graphic Packaging International LLC 15/07/2027              | 28 696           | 0,01              |
| 87 000 3.500% Graphic Packaging International LLC 15/03/2028              | 79 850           | 0,04              |
| 150 000 3.750% Graphic Packaging International LLC 01/02/2030             | 131 022          | 0,07              |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets   | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|---|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>       |                  |   | <b>Valeurs mobilières – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b> |                  |   | <b>Obligations d'entreprise – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 97,42 % (suite)</b>                               |                  |   | <b>Dollar américain – 97,42 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 130 000   | 5.250%           | Great Lakes Dredge & Dock Corp 01/06/2029                                     | 98 340  | 0,05             |                   |
| 1 750 000   | 4.750%           | Grifols Escrow Issuer SA 15/10/2028   | 1 435 752   | 0,74             |                   |
| 150 000   | 4.875%           | Hanesbrands Inc 15/05/2026  | 142 071   | 0,07             |                   |
| 175 000   | 9.000%           | Hanesbrands Inc 15/02/2031  | 179 050   | 0,09             |                   |
| 200 000   | 5.500%           | Harbour Energy PLC 15/10/2026   | 178 038   | 0,09             |                   |
| 730 000   | 6.000%           | HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC 15/04/2025                           | 702 625   | 0,36             |                   |
| 1 780 000   | 3.375%           | HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC 15/06/2026                           | 1 560 722   | 0,81             |                   |
| 1 145 000   | 3.750%           | HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC 15/09/2030                           | 864 406   | 0,45             |                   |
| 140 000   | 4.000%           | HB Fuller Co 15/02/2027   | 129 167   | 0,07             |                   |
| 130 000   | 7.250%           | Hecla Mining Co 15/02/2028  | 131 244   | 0,07             |                   |
| 180 000   | 7.875%           | Herbalife Nutrition Ltd / HLF Financing Inc 01/09/2025                        | 170 222   | 0,09             |                   |
| 330 000   | 5.500%           | Herc Holdings Inc 15/07/2027  | 318 410   | 0,16             |                   |
| 200 000   | 5.375%           | Hilton Domestic Operating Co Inc 01/05/2025                                   | 199 560   | 0,10             |                   |
| 270 000   | 5.750%           | Hilton Domestic Operating Co Inc 01/05/2028                                   | 269 824   | 0,14             |                   |
| 545 000   | 4.875%           | Hilton Domestic Operating Co Inc 15/01/2030                                   | 520 998   | 0,27             |                   |
| 100 000   | 4.000%           | Hilton Domestic Operating Co Inc 01/05/2031                                   | 87 553  | 0,05             |                   |
| 1 150 000   | 3.625%           | Hilton Domestic Operating Co Inc 15/02/2032                                   | 969 496   | 0,50             |                   |
| 500 000   | 4.875%           | Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp 01/04/2027       | 492 095   | 0,25             |                   |
| 100 000   | 4.875%           | HLF Financing Sarl LLC / Herbalife International Inc 01/06/2029               | 77 334  | 0,04             |                   |
| 220 000   | 5.500%           | Horizon Therapeutics USA Inc 01/08/2027                                       | 223 300   | 0,12             |                   |
| 142 000   | 5.375%           | Howard Hughes Corp 01/08/2028   | 129 390   | 0,07             |                   |
| 169 000   | 4.125%           | Howard Hughes Corp 01/02/2029   | 143 004   | 0,07             |                   |
| 136 000   | 5.125%           | Howmet Aerospace Inc 01/10/2024   | 135 705   | 0,07             |                   |
| 100 000   | 6.750%           | Howmet Aerospace Inc 15/01/2028   | 104 974   | 0,05             |                   |
| 330 000   | 3.000%           | Howmet Aerospace Inc 15/01/2029   | 292 090   | 0,15             |                   |
| 100 000   | 5.950%           | Howmet Aerospace Inc 01/02/2037   | 100 802   | 0,05             |                   |
| 250 000   | 4.500%           | Hudbay Minerals Inc 01/04/2026  | 232 552   | 0,12             |                   |
| 200 000   | 6.625%           | Hughes Satellite Systems Corp 01/08/2026                                      | 188 896   | 0,10             |                   |
| 300 000   | 6.750%           | INEOS Finance PLC 15/05/2028  | 291 603   | 0,15             |                   |
| 520 000   | 5.500%           | Interface Inc 01/12/2028  | 423 732   | 0,22             |                   |
| 380 000   | 5.250%           | International Game Technology PLC 15/01/2029                                  | 363 873   | 0,19             |                   |
| 1 550 000   | 5.017%           | Intesa Sanpaolo SpA 26/06/2024  | 1 509 700   | 0,78             |                   |
| 687 000   | 5.710%           | Intesa Sanpaolo SpA 15/01/2026  | 648 391   | 0,34             |                   |
| 1 515 000   | 4.198%           | Intesa Sanpaolo SpA 01/06/2032  | 1 089 527   | 0,56             |                   |
| 1 925 000   | 4.950%           | Intesa Sanpaolo SpA 01/06/2042  | 1 272 560   | 0,66             |                   |
| 270 000   | 5.000%           | IQVIA Inc 15/05/2027  | 264 484   | 0,14             |                   |
| 849 000   | 4.875%           | Iron Mountain Inc 15/09/2027  | 801 914   | 0,41             |                   |
| 130 000   | 5.000%           | Iron Mountain Inc 15/07/2028  | 120 951   | 0,06             |                   |
| 170 000   | 5.250%           | Iron Mountain Inc 15/07/2030  | 153 527   | 0,08             |                   |
| 250 000   | 4.500%           | Iron Mountain Inc 15/02/2031  | 214 765   | 0,11             |                   |
| 200 000   | 5.625%           | Iron Mountain Inc 15/07/2032  | 181 902   | 0,09             |                   |
| 200 000   | 5.000%           | Iron Mountain Information Management Services Inc 15/07/2032                  | 172 214   | 0,09             |                   |
| 300 000   | 7.750%           | Jaguar Land Rover Automotive PLC 15/10/2025                                   | 293 262   | 0,15             |                   |
| 100 000   | 5.875%           | Jaguar Land Rover Automotive PLC 15/01/2028                                   | 84 821  | 0,04             |                   |
| 150 000   | 4.375%           | Jazz Securities DAC 15/01/2029  | 137 999   | 0,07             |                   |
| 60 000  | 4.625%           | JELD-WEN Inc 15/12/2025   | 55 976  | 0,03             |                   |
| 130 000   | 4.875%           | JELD-WEN Inc 15/12/2027   | 110 379   | 0,06             |                   |
| 104 000   | 8.500%           | Jones Deslauriers Insurance Management Inc 15/03/2030                         | 108 438   | 0,06             |                   |
| 100 000   | 4.625%           | Kaiser Aluminum Corp 01/03/2028   | 89 684  | 0,05             |                   |
| 150 000   | 4.500%           | Kaiser Aluminum Corp 01/06/2031   | 123 242   | 0,06             |                   |
| 30 000  | 4.800%           | KB Home 15/11/2029  | 27 469  | 0,01             |                   |
| 170 000   | 7.250%           | KB Home 15/07/2030  | 172 655   | 0,09             |                   |
| 80 000  | 4.750%           | Kennedy-Wilson Inc 01/03/2029   | 63 592  | 0,03             |                   |
| 80 000  | 4.750%           | Kennedy-Wilson Inc 01/02/2030   | 59 093  | 0,03             |                   |
| 100 000   | 5.000%           | Kennedy-Wilson Inc 01/03/2031   | 73 645  | 0,04             |                   |
| 1 281 000   | 4.750%           | KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC 01/06/2027     | 1 255 303   | 0,65             |                   |
| 300 000   | 5.550%           | Kohl's Corp 17/07/2045  | 173 148   | 0,09             |                   |
| 150 000   | 4.125%           | Kontoor Brands Inc 15/11/2029   | 128 153   | 0,07             |                   |
| 100 000   | 6.000%           | Koppers Inc 15/02/2025  | 99 973  | 0,05             |                   |
| 107 000   | 9.500%           | LABL Inc 01/11/2028   | 108 084   | 0,06             |                   |
| 250 000   | 5.250%           | Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp 01/10/2025 | 220 877   | 0,11             |                   |
| 700 000   | 4.250%           | Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp 01/02/2027 | 552 811   | 0,29             |                   |
| 170 000   | 4.125%           | Lamb Weston Holdings Inc 31/01/2030   | 155 628   | 0,08             |                   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>                       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>            |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>                 |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>      |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 97,42 % (suite)</b>   |                  |                   | <b>Dollar américain – 97,42 % (suite)</b>                                    |                  |                   |
| 550 000 7.750% Lannett Co Inc 15/04/2026  | 93 506           | 0,05              | 50 000 4.250% Methanex Corp 01/12/2024                                       | 48 425           | 0,03              |
| 400 000 3.200% Las Vegas Sands Corp 08/08/2024  | 386 740          | 0,20              | 132 000 5.250% Methanex Corp 15/12/2029                                      | 123 378          | 0,06              |
| 200 000 3.500% Las Vegas Sands Corp 18/08/2026  | 186 412          | 0,10              | 80 000 5.650% Methanex Corp 01/12/2044                                       | 65 623           | 0,03              |
| 100 000 4.625% Level 3 Financing Inc 15/09/2027   | 60 071           | 0,03              | 130 000 5.375% MGM China Holdings Ltd 15/05/2024                             | 127 310          | 0,07              |
| 150 000 4.250% Level 3 Financing Inc 01/07/2028   | 84 530           | 0,04              | 300 000 5.875% MGM China Holdings Ltd 15/05/2026                             | 283 116          | 0,15              |
| 550 000 3.625% Level 3 Financing Inc 15/01/2029   | 303 561          | 0,16              | 230 000 6.750% MGM Resorts International 01/05/2025                          | 231 937          | 0,12              |
| 100 000 3.750% Level 3 Financing Inc 15/07/2029   | 53 387           | 0,03              | 141 000 4.625% MGM Resorts International 01/09/2026                          | 133 320          | 0,07              |
| 1 041 000 3.500% Levi Strauss & Co 01/03/2031   | 888 192          | 0,46              | 230 000 5.500% MGM Resorts International 15/04/2027                          | 222 865          | 0,12              |
| 200 000 8.500% Liberty Interactive LLC 15/07/2029                                       | 50 034           | 0,03              | 374 000 8.000% Mineral Resources Ltd 01/11/2027                              | 384 524          | 0,20              |
| 400 000 3.875% Lithia Motors Inc 01/06/2029   | 345 888          | 0,18              | 100 000 4.000% Mueller Water Products Inc 15/06/2029                         | 89 953           | 0,05              |
| 75 000 4.375% LPL Holdings Inc 15/05/2031   | 66 356           | 0,03              | 22 000 5.750% Murphy Oil Corp 15/08/2025                                     | 21 837           | 0,01              |
| 700 000 4.000% Lumen Technologies Inc 15/02/2027  | 462 350          | 0,24              | 350 000 5.875% Murphy Oil Corp 01/12/2027                                    | 342 282          | 0,18              |
| 50 000 7.600% Lumen Technologies Inc 15/09/2039   | 19 123           | 0,01              | 50 000 6.125% Murphy Oil Corp 01/12/2042                                     | 41 424           | 0,02              |
| 210 000 6.700% Macy's Retail Holdings LLC 15/07/2034                                    | 172 486          | 0,09              | 530 000 5.750% Nabors Industries Inc 01/02/2025                              | 513 066          | 0,27              |
| 100 000 6.375% Macy's Retail Holdings LLC 15/03/2037                                    | 80 659           | 0,04              | 495 000 7.375% Nabors Industries Inc 15/05/2027                              | 484 729          | 0,25              |
| 86 000 4.300% Macy's Retail Holdings LLC 15/02/2043                                     | 53 162           | 0,03              | 125 000 7.250% Nabors Industries Ltd 15/01/2026                              | 119 194          | 0,06              |
| 100 000 9.000% Manitowoc Co Inc 01/04/2026  | 100 049          | 0,05              | 100 000 7.500% Nabors Industries Ltd 15/01/2028                              | 91 874           | 0,05              |
| 130 000 7.125% Marks & Spencer PLC 01/12/2037   | 120 103          | 0,06              | 30 000 5.000% Navient Corp 15/03/2027  | 26 555           | 0,01              |
| 188 000 11.500% Martin Midstream Partners LP / Martin Midstream Finance Corp 15/02/2028 | 180 096          | 0,09              | 101 000 4.875% Navient Corp 15/03/2028                                       | 84 990           | 0,04              |
| 50 000 3.500% Masonite International Corp 15/02/2030                                    | 41 570           | 0,02              | 130 000 3.625% NCL Corp Ltd 15/12/2024                                       | 121 797          | 0,06              |
| 400 000 5.000% Match Group Holdings II LLC 15/12/2027                                   | 378 528          | 0,20              | 600 000 5.875% NCL Corp Ltd 15/02/2027                                       | 559 458          | 0,29              |
| 500 000 7.875% Mauser Packaging Solutions Holding Co 15/08/2026                         | 499 810          | 0,26              | 83 000 8.375% NCL Corp Ltd 01/02/2028  | 83 339           | 0,04              |
| 100 000 9.250% Mauser Packaging Solutions Holding Co 15/04/2027                         | 92 350           | 0,05              | 597 000 5.125% NCR Corp 15/04/2029   | 517 742          | 0,27              |
| 200 000 4.875% Melco Resorts Finance Ltd 06/06/2025                                     | 186 958          | 0,10              | 50 000 7.500% New Gold Inc 15/07/2027  | 48 056           | 0,02              |
| 250 000 5.250% Melco Resorts Finance Ltd 26/04/2026                                     | 225 282          | 0,12              | 80 000 4.000% Newell Brands Inc 01/12/2024                                   | 77 322           | 0,04              |
| 30 000 5.625% Melco Resorts Finance Ltd 17/07/2027                                      | 26 106           | 0,01              | 415 000 4.700% Newell Brands Inc 01/04/2026                                  | 399 541          | 0,21              |
| 280 000 5.375% Melco Resorts Finance Ltd 04/12/2029                                     | 227 382          | 0,12              | 85 000 6.375% Newell Brands Inc 15/09/2027                                   | 85 775           | 0,04              |
| 200 000 5.500% Mercer International Inc 15/01/2026                                      | 194 758          | 0,10              | 72 000 6.625% Newell Brands Inc 15/09/2029                                   | 72 570           | 0,04              |
| 2 400 000 5.125% Mercer International Inc 01/02/2029                                    | 2 055 840        | 1,06              | 200 000 5.625% Newell Brands Inc 01/04/2036                                  | 177 170          | 0,09              |
|   |                  |                   | 20 000 4.250% NextEra Energy Operating Partners LP 15/07/2024                | 19 736           | 0,01              |
|   |                  |                   | 14 000 4.250% NextEra Energy Operating Partners LP 15/09/2024                | 13 424           | 0,01              |
|   |                  |                   | 150 000 3.875% NextEra Energy Operating Partners LP 15/10/2026               | 140 154          | 0,07              |
|   |                  |                   | 1 000 7.500% NFP Corp 01/10/2030   | 966              | 0,00              |
|   |                  |                   | 100 000 7.500% NGL Energy Operating LLC / NGL Energy Finance Corp 01/02/2026 | 96 528           | 0,05              |
|   |                  |                   | 550 000 6.625% Nokia Oyj 15/05/2039  | 549 246          | 0,28              |
|   |                  |                   | 550 000 5.000% Nordstrom Inc 15/01/2044                                      | 345 845          | 0,18              |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>                                    |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 97,42 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 97,42 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 630 000 4.750% Novelis Corp 30/01/2030                                  | 579 064          | 0,30              | 166 000 4.125% Open Text Holdings Inc 01/12/2031   | 136 955          | 0,07              |
| 350 000 3.625% NRG Energy Inc 15/02/2031                                | 283 720          | 0,15              | 1 000 000 4.125% Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 30/04/2028                               | 920 360          | 0,48              |
| 280 000 3.875% NRG Energy Inc 15/02/2032                                | 224 162          | 0,12              | 170 000 5.000% Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp 15/08/2027                         | 154 804          | 0,08              |
| 60 000 6.000% NuStar Logistics LP 01/06/2026                            | 58 616           | 0,03              | 230 000 4.500% Owens & Minor Inc 31/03/2029  | 182 549          | 0,09              |
| 250 000 5.625% NuStar Logistics LP 28/04/2027                           | 237 487          | 0,12              | 104 000 6.625% Owens & Minor Inc 01/04/2030  | 89 291           | 0,05              |
| 210 000 6.950% Occidental Petroleum Corp 01/07/2024                     | 212 919          | 0,11              | 400 000 7.500% Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer 01/06/2025 | 402 400          | 0,21              |
| 200 000 5.875% Occidental Petroleum Corp 01/09/2025                     | 202 032          | 0,10              | 250 000 5.875% Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer 01/10/2028 | 230 127          | 0,12              |
| 650 000 8.500% Occidental Petroleum Corp 15/07/2027                     | 713 700          | 0,37              | 60 000 4.875% Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer 15/05/2029  | 51 608           | 0,03              |
| 200 000 6.375% Occidental Petroleum Corp 01/09/2028                     | 207 580          | 0,11              | 100 000 3.950% Patterson-UTI Energy Inc 01/02/2028   | 90 001           | 0,05              |
| 150 000 3.500% Occidental Petroleum Corp 15/08/2029                     | 134 400          | 0,07              | 38 000 8.000% PECF USS Intermediate Holding III Corp 15/11/2029  | 25 012           | 0,01              |
| 200 000 8.875% Occidental Petroleum Corp 15/07/2030                     | 232 368          | 0,12              | 230 000 5.375% PennyMac Financial Services Inc 15/10/2025  | 214 774          | 0,11              |
| 400 000 6.625% Occidental Petroleum Corp 01/09/2030                     | 421 080          | 0,22              | 100 000 4.250% PennyMac Financial Services Inc 15/02/2029  | 79 615           | 0,04              |
| 300 000 6.125% Occidental Petroleum Corp 01/01/2031                     | 311 340          | 0,16              | 200 000 4.375% Perrigo Finance Unlimited Co 15/03/2026   | 192 692          | 0,10              |
| 319 000 6.450% Occidental Petroleum Corp 15/09/2036                     | 335 566          | 0,17              | 150 000 4.400% Perrigo Finance Unlimited Co 15/06/2030   | 134 528          | 0,07              |
| 200 000 4.625% Occidental Petroleum Corp 15/06/2045                     | 161 072          | 0,08              | 200 000 9.750% Petrofac Ltd 15/11/2026   | 147 682          | 0,08              |
| 250 000 6.600% Occidental Petroleum Corp 15/03/2046                     | 262 975          | 0,14              | 100 000 4.250% Pilgrim's Pride Corp 15/04/2031   | 87 270           | 0,05              |
| 600 000 4.400% Occidental Petroleum Corp 15/04/2046                     | 477 588          | 0,25              | 100 000 6.875% Pitney Bowes Inc 15/03/2027   | 79 133           | 0,04              |
| 505 000 4.400% Occidental Petroleum Corp 15/08/2049                     | 394 819          | 0,20              | 50 000 7.250% Pitney Bowes Inc 15/03/2029  | 37 497           | 0,02              |
| 200 000 4.750% OI European Group BV 15/02/2030                          | 183 004          | 0,09              | 1 000 000 4.625% Post Holdings Inc 15/04/2030  | 896 430          | 0,46              |
| 100 000 3.875% ON Semiconductor Corp 01/09/2028                         | 90 827           | 0,05              | 30 000 7.375% PRA Group Inc 01/09/2025   | 29 864           | 0,02              |
| 517 000 6.125% OneMain Finance Corp 15/03/2024                          | 503 708          | 0,26              | 100 000 8.375% PRA Group Inc 01/02/2028  | 99 974           | 0,05              |
| 200 000 6.875% OneMain Finance Corp 15/03/2025                          | 193 884          | 0,10              | 100 000 5.000% PRA Group Inc 01/10/2029  | 83 626           | 0,04              |
| 643 000 7.125% OneMain Finance Corp 15/03/2026                          | 617 820          | 0,32              | 30 000 5.250% Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc 15/04/2024                          | 29 758           | 0,02              |
| 130 000 3.500% OneMain Finance Corp 15/01/2027                          | 109 217          | 0,06              | 60 000 7.405% Provident Financing Trust I 15/03/2038   | 60 257           | 0,03              |
| 250 000 3.875% OneMain Finance Corp 15/09/2028                          | 197 775          | 0,10              | 200 000 4.750% QVC Inc 15/02/2027  | 83 936           | 0,04              |
| 1 170 000 5.375% OneMain Finance Corp 15/11/2029                        | 984 064          | 0,51              | 130 000 7.250% Qwest Corp 15/09/2025   | 121 337          | 0,06              |
| 650 000 4.000% OneMain Finance Corp 15/09/2030                          | 487 220          | 0,25              | 330 000 3.500% Rackspace Technology Global Inc 15/02/2028  | 171 326          | 0,09              |
| 443 000 3.875% Open Text Corp 01/12/2029                                | 373 236          | 0,19              | 250 000 10.250% Rakuten Group Inc 30/11/2024   | 241 725          | 0,13              |
|   |                  |                   | 200 000 5.125% Rakuten Group Inc 31/12/2099  | 122 668          | 0,06              |
|   |                  |                   | 800 000 6.250% Rakuten Group Inc (Perpetual)   | 428 056          | 0,22              |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>       |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>         |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>   |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 97,42 % (suite)</b>                               |                  |                   | <b>Dollar américain – 97,42 % (suite)</b>                                 |                  |                   |
| 300 000 8.500% Rand Parent LLC 15/02/2030                               | 281 970          | 0,15              | 130 000 4.000% Sealed Air Corp 01/12/2027                                 | 121 339          | 0,06              |
| 306 000 4.875% Range Resources Corp 15/05/2025                          | 302 573          | 0,16              | 64 000 6.125% Sealed Air Corp 01/02/2028                                  | 64 761           | 0,03              |
| 29 000 4.750% Range Resources Corp 15/02/2030                           | 26 445           | 0,01              | 105 000 6.875% Sealed Air Corp 15/07/2033                                 | 106 898          | 0,06              |
| 90 000 4.750% RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp 15/10/2027     | 84 352           | 0,04              | 88 000 5.875% Sensata Technologies BV 01/09/2030                          | 87 167           | 0,05              |
| 30 000 4.500% RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp 15/02/2029     | 27 115           | 0,01              | 90 000 4.375% Sensata Technologies Inc 15/02/2030                         | 82 529           | 0,04              |
| 50 000 6.750% Ritchie Bros Auctioneers Inc 15/03/2028                   | 51 554           | 0,03              | 200 000 7.875% Sigma Holdco BV 15/05/2026                                 | 158 686          | 0,08              |
| 50 000 7.750% Ritchie Bros Auctioneers Inc 15/03/2031                   | 52 516           | 0,03              | 50 000 4.200% SLM Corp 29/10/2025   | 45 016           | 0,02              |
| 100 000 3.750% RLJ Lodging Trust LP 01/07/2026                          | 92 149           | 0,05              | 333 000 6.450% Southwestern Energy Co 23/01/2025                          | 333 240          | 0,17              |
| 50 000 4.000% RLJ Lodging Trust LP 15/09/2029                           | 42 433           | 0,02              | 120 000 5.375% Southwestern Energy Co 15/03/2030                          | 112 678          | 0,06              |
| 60 000 3.625% Rolls-Royce PLC 14/10/2025                                | 56 997           | 0,03              | 450 000 4.750% Southwestern Energy Co 01/02/2032                          | 397 642          | 0,21              |
| 150 000 5.750% Rolls-Royce PLC 15/10/2027                               | 150 084          | 0,08              | 303 000 3.850% Spirit AeroSystems Inc 15/06/2026                          | 285 971          | 0,15              |
| 150 000 11.500% Royal Caribbean Cruises Ltd 01/06/2025                  | 159 962          | 0,08              | 180 000 4.600% Spirit AeroSystems Inc 15/06/2028                          | 152 532          | 0,08              |
| 1 115 000 4.250% Royal Caribbean Cruises Ltd 01/07/2026                 | 1 000 657        | 0,52              | 100 000 9.375% Spirit AeroSystems Inc 30/11/2029                          | 109 156          | 0,06              |
| 889 000 5.500% Royal Caribbean Cruises Ltd 31/08/2026                   | 826 317          | 0,43              | 80 000 8.000% Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd 20/09/2025 | 80 521           | 0,04              |
| 816 000 5.375% Royal Caribbean Cruises Ltd 15/07/2027                   | 727 440          | 0,38              | 400 000 6.875% Sprint Capital Corp 15/11/2028                             | 429 924          | 0,22              |
| 115 000 11.625% Royal Caribbean Cruises Ltd 15/08/2027                  | 123 526          | 0,06              | 180 000 8.750% Sprint Capital Corp 15/03/2032                             | 219 069          | 0,11              |
| 112 000 7.500% Royal Caribbean Cruises Ltd 15/10/2027                   | 105 688          | 0,05              | 32 000 7.125% Sprint LLC 15/06/2024                                       | 32 564           | 0,02              |
| 900 000 3.700% Royal Caribbean Cruises Ltd 15/03/2028                   | 736 038          | 0,38              | 600 000 7.625% Sprint LLC 15/02/2025                                      | 623 124          | 0,32              |
| 450 000 5.500% Royal Caribbean Cruises Ltd 01/04/2028                   | 397 035          | 0,21              | 70 000 7.625% Sprint LLC 01/03/2026                                       | 74 031           | 0,04              |
| 400 000 8.250% Royal Caribbean Cruises Ltd 15/01/2029                   | 418 472          | 0,22              | 1 103 000 10.750% Staples Inc 15/04/2027                                  | 799 874          | 0,41              |
| 125 000 9.250% Royal Caribbean Cruises Ltd 15/01/2029                   | 132 861          | 0,07              | 200 000 4.500% Station Casinos LLC 15/02/2028                             | 180 434          | 0,09              |
| 190 000 7.250% Royal Caribbean Cruises Ltd 15/01/2030                   | 191 182          | 0,10              | 100 000 5.125% Steelcase Inc 18/01/2029                                   | 89 901           | 0,05              |
| 1 410 000 11.250% Sabre GLOBAL Inc 15/12/2027                           | 1 310 651        | 0,68              | 155 000 3.875% Stericycle Inc 15/01/2029                                  | 136 674          | 0,07              |
| 430 000 5.900% Sands China Ltd 08/08/2028                               | 405 533          | 0,21              | 1 360 000 6.000% Studio City Finance Ltd 15/07/2025                       | 1 253 893        | 0,65              |
| 500 000 3.350% Sands China Ltd 08/03/2029                               | 414 295          | 0,21              | 80 000 4.875% SunCoke Energy Inc 30/06/2029                               | 70 162           | 0,04              |
| 200 000 4.875% Seagate HDD Cayman 01/03/2024                            | 197 590          | 0,10              | 50 000 5.875% Sunnova Energy Corp 01/09/2026                              | 42 405           | 0,02              |
| 200 000 4.091% Seagate HDD Cayman 01/06/2029                            | 178 722          | 0,09              | 375 000 7.250% Synchrony Financial 02/02/2033                             | 328 185          | 0,17              |
| 51 000 4.125% Seagate HDD Cayman 15/01/2031                             | 42 952           | 0,02              | 100 000 7.000% Taseko Mines Ltd 15/02/2026                                | 91 211           | 0,05              |
| 200 000 5.750% Seagate HDD Cayman 01/12/2034                            | 182 442          | 0,09              | 60 000 5.875% Taylor Morrison Communities Inc 15/06/2027                  | 59 047           | 0,03              |
|   |                  |                   | 200 000 5.750% Taylor Morrison Communities Inc 15/01/2028                 | 196 488          | 0,10              |
|   |                  |                   | 259 000 6.000% Telecom Italia Capital SA 30/09/2034                       | 221 240          | 0,11              |
|   |                  |                   | 350 000 7.200% Telecom Italia Capital SA 18/07/2036                       | 317 464          | 0,16              |
|   |                  |                   | 1 400 000 5.303% Telecom Italia SpA/Milano 30/05/2024                     | 1 371 692        | 0,71              |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets  | Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|--|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>       |                  |  | <b>Valeurs mobilières – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>       |                  |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b> |                  |  | <b>Obligations d'entreprise – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 97,42 % (suite)</b>                               |                  |  | <b>Dollar américain – 97,42 % (suite)</b>                               |                  |                   |
| 1 200 000   | 5.500%           | Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 01/03/2028                           | 1 110 744   | 0,57             |                   |
| 100 000   | 4.000%           | Tempur Sealy International Inc 15/04/2029                                  | 87 955  | 0,05             |                   |
| 200 000   | 3.875%           | Tempur Sealy International Inc 15/10/2031                                  | 167 012   | 0,09             |                   |
| 70 000  | 4.625%           | Tenet Healthcare Corp 01/09/2024   | 69 017  | 0,04             |                   |
| 70 000  | 4.875%           | Tenet Healthcare Corp 01/01/2026   | 68 624  | 0,04             |                   |
| 170 000   | 5.125%           | Tenet Healthcare Corp 01/11/2027   | 163 933   | 0,08             |                   |
| 200 000   | 6.125%           | Tenet Healthcare Corp 01/10/2028   | 190 688   | 0,10             |                   |
| 357 000   | 4.375%           | Tenet Healthcare Corp 15/01/2030   | 320 500   | 0,17             |                   |
| 1 200 000   | 5.000%           | Terex Corp 15/05/2029  | 1 115 268   | 0,58             |                   |
| 130 000   | 3.625%           | TopBuild Corp 15/03/2029   | 111 569   | 0,06             |                   |
| 650 000   | 6.750%           | TransDigm Inc 15/08/2028   | 656 500   | 0,34             |                   |
| 650 000   | 7.250%           | Transocean Inc 01/11/2025  | 613 470   | 0,32             |                   |
| 850 000   | 7.500%           | Transocean Inc 15/01/2026  | 772 709   | 0,40             |                   |
| 1 250 000   | 11.500%          | Transocean Inc 30/01/2027  | 1 292 200   | 0,67             |                   |
| 1 250 000   | 8.000%           | Transocean Inc 01/02/2027  | 1 116 762   | 0,58             |                   |
| 200 000   | 8.750%           | Transocean Inc 15/02/2030  | 204 000   | 0,11             |                   |
| 200 000   | 8.375%           | Transocean Titan Financing Ltd 01/02/2028                                  | 205 076   | 0,11             |                   |
| 150 000   | 6.600%           | Travel + Leisure Co 01/10/2025   | 150 855   | 0,08             |                   |
| 122 000   | 4.500%           | Travel + Leisure Co 01/12/2029   | 106 300   | 0,06             |                   |
| 400 000   | 4.000%           | TreeHouse Foods Inc 01/09/2028   | 354 068   | 0,18             |                   |
| 50 000  | 4.125%           | TriMas Corp 15/04/2029   | 44 345  | 0,02             |                   |
| 50 000  | 4.550%           | Trinity Industries Inc 01/10/2024  | 48 339  | 0,03             |                   |
| 250 000   | 5.125%           | Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc 01/04/2029 | 149 018   | 0,08             |                   |
| 171 000   | 9.000%           | Triumph Group Inc 15/03/2028   | 171 593   | 0,09             |                   |
| 130 000   | 4.625%           | Tronox Inc 15/03/2029  | 108 839   | 0,06             |                   |
| 130 000   | 4.000%           | TTM Technologies Inc 01/03/2029  | 113 094   | 0,06             |                   |
| 350 000   | 3.625%           | Twilio Inc 15/03/2029  | 303 282   | 0,16             |                   |
| 265 000   | 7.500%           | Uber Technologies Inc 15/05/2025   | 268 262   | 0,14             |                   |
| 450 000   | 8.000%           | Uber Technologies Inc 01/11/2026   | 461 281   | 0,24             |                   |
| 490 000   | 7.500%           | Uber Technologies Inc 15/09/2027   | 505 107   | 0,26             |                   |
| 50 000  | 6.250%           | Uber Technologies Inc 15/01/2028   | 49 908  | 0,03             |                   |
| 250 000   | 4.500%           | Uber Technologies Inc 15/08/2029   | 228 130   | 0,12             |                   |
| 250 000   | 5.861%           | UniCredit SpA 19/06/2032   | 221 427   | 0,11             |                   |
| 404 000   | 7.296%           | UniCredit SpA 02/04/2034   | 378 225   | 0,20             |                   |
| 1 920 000   | 5.459%           | UniCredit SpA 30/06/2035   | 1 573 325   | 0,81             |                   |
| 1 030 000   | 6.875%           | Unisys Corp 01/11/2027   | 657 233   | 0,34             |                   |
| 44 342  | 3.500%           | United Airlines 2019-2 Class B Pass Through Trust 01/11/2029               | 39 565  | 0,02             |                   |
| 530 000   | 4.375%           | United Airlines Inc 15/04/2026   | 508 217   | 0,26             |                   |
| 250 000   | 4.625%           | United Airlines Inc 15/04/2029   | 226 102   | 0,12             |                   |
| 100 000   | 6.750%           | United Natural Foods Inc 15/10/2028  | 92 799  | 0,05             |                   |
| 130 000   | 5.500%           | United Rentals North America Inc 15/05/2027                                | 128 835   | 0,07             |                   |
| 105 000   | 3.875%           | United Rentals North America Inc 15/11/2027                                | 98 381  | 0,05             |                   |
| 691 000   | 4.875%           | United Rentals North America Inc 15/01/2028                                | 660 762   | 0,34             |                   |
| 550 000   | 3.875%           | United Rentals North America Inc 15/02/2031                                | 485 254   | 0,25             |                   |
| 1 757 000   | 4.875%           | UPC Broadband Finco BV 15/07/2031  | 1 518 716   | 0,79             |                   |
| 1 499 000   | 5.500%           | UPC Holding BV 15/01/2028  | 1 339 476   | 0,69             |                   |
| 200 000   | 6.250%           | US Foods Inc 15/04/2025  | 201 894   | 0,10             |                   |
| 200 000   | 4.750%           | US Foods Inc 15/02/2029  | 184 700   | 0,10             |                   |
| 80 000  | 7.875%           | Varex Imaging Corp 15/10/2027  | 78 622  | 0,04             |                   |
| 470 000   | 5.625%           | Vermilion Energy Inc 15/03/2025  | 463 617   | 0,24             |                   |
| 83 000  | 6.875%           | Vermilion Energy Inc 01/05/2030  | 75 791  | 0,04             |                   |
| 250 000   | 4.125%           | Vertiv Group Corp 15/11/2028   | 222 280   | 0,11             |                   |
| 168 000   | 5.625%           | Viasat Inc 15/09/2025  | 159 358   | 0,08             |                   |
| 182 000   | 6.500%           | Viasat Inc 15/07/2028  | 133 563   | 0,07             |                   |
| 1 065 000   | 4.625%           | Victoria's Secret & Co 15/07/2029  | 861 798   | 0,45             |                   |
| 50 000  | 3.625%           | Videotron Ltd 15/06/2029   | 43 067  | 0,02             |                   |
| 1 320 000   | 5.000%           | Virgin Media Finance PLC 15/07/2030  | 1 090 135   | 0,56             |                   |
| 340 000   | 5.500%           | Virgin Media Secured Finance PLC 15/05/2029                                | 316 010   | 0,16             |                   |
| 450 000   | 5.000%           | Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC 15/07/2028                      | 399 703   | 0,21             |                   |
| 250 000   | 7.750%           | Vital Energy Inc 31/07/2029  | 208 223   | 0,11             |                   |
| 170 000   | 4.250%           | Vmed O2 UK Financing I PLC 31/01/2031                                      | 144 583   | 0,07             |                   |
| 600 000   | 4.750%           | Vmed O2 UK Financing I PLC 15/07/2031                                      | 514 182   | 0,27             |                   |
| 1 400 000   | 7.000%           | Vodafone Group PLC 04/04/2079  | 1 395 324   | 0,72             |                   |
| 1 140 000   | 3.250%           | Vodafone Group PLC 04/06/2081  | 968 875   | 0,50             |                   |
| 1 930 000   | 4.125%           | Vodafone Group PLC 04/06/2081  | 1 519 373   | 0,79             |                   |
| 620 000   | 5.125%           | Vodafone Group PLC 04/06/2081  | 450 895   | 0,23             |                   |
| 280 000   | 5.750%           | WASH Multifamily Acquisition Inc 15/04/2026                                | 264 673   | 0,14             |                   |
| 181 000   | 6.500%           | Weatherford International Ltd 15/09/2028                                   | 181 300   | 0,09             |                   |
| 800 000   | 8.625%           | Weatherford International Ltd 30/04/2030                                   | 810 168   | 0,42             |                   |



## SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|--|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>          |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>              |                    |                   |
| <b>Obligations d'entreprise – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>    |                  |                   | <b>Obligations d'entreprise – 97,42 % (mars 2022 : 99,42 %) (suite)</b>        |                    |                   |
| <b>Dollar américain – 97,42 % (suite)</b>                                  |                  |                   | <b>Dollar américain – 97,42 % (suite)</b>                                      |                    |                   |
| 110 000 2.200% Weir Group PLC 13/05/2026                                   | 99 066           | 0,05              | 100 000 5.500% Wynn Macau Ltd 01/10/2027                                       | 87 495             | 0,05              |
| 400 000 7.125% WESCO Distribution Inc 15/06/2025                           | 406 728          | 0,21              | 200 000 5.625% Wynn Macau Ltd 26/08/2028                                       | 170 080            | 0,09              |
| 50 000 7.250% WESCO Distribution Inc 15/06/2028                            | 51 383           | 0,03              | 650 000 5.125% Wynn Macau Ltd 15/12/2029                                       | 527 884            | 0,27              |
| 200 000 4.100% Western Midstream Operating LP 01/02/2025                   | 191 218          | 0,10              | 100 000 5.125% Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp 01/10/2029 | 90 760             | 0,05              |
| 200 000 4.650% Western Midstream Operating LP 01/07/2026                   | 193 598          | 0,10              | 200 000 7.125% Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp 15/02/2031 | 202 828            | 0,10              |
| 100 000 4.550% Western Midstream Operating LP 01/02/2030                   | 90 956           | 0,05              | 150 000 4.800% Xerox Corp 01/03/2035   | 94 836             | 0,05              |
| 340 000 5.450% Western Midstream Operating LP 01/04/2044                   | 296 772          | 0,15              | 150 000 6.750% Xerox Corp 15/12/2039   | 109 077            | 0,06              |
| 200 000 5.750% Western Midstream Operating LP 01/02/2050                   | 169 874          | 0,09              | 310 000 5.000% Xerox Holdings Corp 15/08/2025                                  | 292 625            | 0,15              |
| 150 000 7.375% WR Grace Holdings LLC 01/03/2031                            | 150 303          | 0,08              | 250 000 6.375% XHR LP 15/08/2025   | 245 205            | 0,13              |
| 150 000 4.375% Wyndham Hotels & Resorts Inc 15/08/2028                     | 138 242          | 0,07              | 65 000 7.500% XPO Escrow Sub LLC 15/11/2027                                    | 67 578             | 0,03              |
| 530 000 5.500% Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp 01/03/2025 | 519 161          | 0,27              | 1 465 000 4.750% Yum! Brands Inc 15/01/2030                                    | 1 399 705          | 0,72              |
| 250 000 4.875% Wynn Macau Ltd 01/10/2024                                   | 241 665          | 0,13              | 321 000 3.625% Yum! Brands Inc 15/03/2031                                      | 281 565            | 0,15              |
|  |                  |                   | 163 000 5.375% Yum! Brands Inc 01/04/2032                                      | 157 716            | 0,08              |
|  |                  |                   | 100 000 5.350% Yum! Brands Inc 01/11/2043                                      | 87 026             | 0,05              |
|  |                  |                   | <b>Total des obligations d'entreprise</b>                                      | <b>188 411 661</b> | <b>97,42</b>      |
|  |                  |                   | <b>Total des valeurs mobilières</b>  | <b>188 411 661</b> | <b>97,42</b>      |

Instruments financiers dérivés – 0,72 % (mars 2022 : 0,00 %)

Contrats de change à terme – 0,72 % (mars 2022 : 0,00 %)^

| Devise achetée  | Devise vendue | Montant acheté | Montant vendu | Date d'échéance | Contrepartie                | Plus-values/ (Moins-values) latentes USD | % du Comp.    |
|---|---------------|----------------|---------------|-----------------|-----------------------------|--|---------------|
| EUR   | USD           | 12 552 349     | 13 282 595    | 04/04/2023      | Bank of Montreal            | 354 904                                  | 0,18          |
| EUR   | USD           | 12 554 938     | 13 282 598    | 04/04/2023      | Westpac Banking Corporation | 357 714                                  | 0,19          |
| EUR   | USD           | 12 555 031     | 13 282 595    | 04/04/2023      | Bank of America             | 357 817                                  | 0,19          |
| EUR   | USD           | 13 530 055     | 14 325 595    | 04/04/2023      | Citibank                    | 374 132                                  | 0,19          |
| EUR   | USD           | 11 844 278     | 12 940 348    | 02/05/2023      | Royal Bank of Canada        | (51 929)                                 | (0,03)        |
| EUR   | USD           | 11 846 065     | 12 940 345    | 02/05/2023      | Westpac Banking Corporation | (49 982)                                 | (0,03)        |
| EUR   | USD           | 11 847 203     | 12 940 345    | 02/05/2023      | Citibank                    | (48 743)                                 | (0,03)        |
| EUR   | USD           | 11 853 346     | 12 940 345    | 02/05/2023      | Morgan Stanley              | (42 059)                                 | (0,02)        |
| USD   | EUR           | 2 412 000      | 2 269 985     | 04/04/2023      | Bank of Montreal            | (54 225)                                 | (0,03)        |
| USD   | EUR           | 12 940 345     | 11 872 878    | 04/04/2023      | Morgan Stanley              | 41 058                                   | 0,02          |
| USD   | EUR           | 12 940 345     | 11 865 696    | 04/04/2023      | Citibank                    | 48 861                                   | 0,03          |
| USD   | EUR           | 12 940 345     | 11 864 692    | 04/04/2023      | Westpac Banking Corporation | 49 951                                   | 0,03          |
| USD   | EUR           | 12 940 348     | 11 863 095    | 04/04/2023      | Royal Bank of Canada        | 51 689                                   | 0,03          |
| <b>Plus-values latentes sur contrats de change à terme</b>        |               |                |               |                 |                             | <b>1 636 126</b>                         | <b>0,86</b>   |
| <b>Moins-values latentes sur contrats de change à terme</b>       |               |                |               |                 |                             | <b>(246 938)</b>                         | <b>(0,14)</b> |
| <b>Plus-values latentes nettes sur contrats de change à terme</b> |               |                |               |                 |                             | <b>1 389 188</b>                         | <b>0,72</b>   |
| <b>Total des instruments financiers dérivés</b>                   |               |                |               |                 |                             | <b>1 389 188</b>                         | <b>0,72</b>   |

## SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

|   | Juste valeur<br>USD       | % du<br>Comp.        |
|---|---------------------------|----------------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | 189 800 849               | 98,14                |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 1,39 %)</b>                               | 693 245                   | 0,36                 |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : (0,81 %))</b>                                    | <u>2 906 450</u>          | <u>1,50</u>          |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b><u>193 400 544</u></b> | <b><u>100,00</u></b> |

<sup>^</sup> Les contrats à terme sont utilisés à des fins de couverture.

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

|  | % du<br>total<br>des<br>actifs |
|--|--------------------------------|
| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                                   |                                |
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs            | 44,79                          |
| Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé                        | 45,53                          |
| Autres valeurs mobilières du type mentionné dans le Règlement 68(1)(a), (b) et (c) | 6,85                           |
| Instruments financiers dérivés négociés de gré à gré                               | 0,85                           |
| Autres actifs  | <u>1,98</u>                    |
| <b>Total des actifs</b>  | <b><u>100,00</u></b>           |

## SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD        | 2022<br>USD        |
|--|-------|--------------------|--------------------|
| <b>Actifs circulants</b>   |       |                    |                    |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                         | 1(e)  |                    |                    |
| Valeurs mobilières   |       | 251 721 799        | 337 509 440        |
| Instruments financiers dérivés   |       | 24 382             | 161 244            |
|  |       | <b>251 746 181</b> | <b>337 670 684</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie  | 1(f)  | 736 941            | 2 943 691          |
| Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties à des instruments financiers ouverts | 1(g)  | 96 018             | -                  |
| Créances :   |       |                    |                    |
| Dividendes à recevoir  |       | 975 325            | 988 972            |
| À recevoir sur cessions d'investissements  |       | 3 769              | -                  |
| <b>Total des actifs circulants</b>   |       | <b>253 558 234</b> | <b>341 603 347</b> |
| <b>Passifs circulants</b>  |       |                    |                    |
| Découverts bancaires   | 1(f)  | (39 779)           | -                  |
| Liquidités dues aux courtiers et aux contreparties pour des instruments financiers ouverts       | 1(g)  | -                  | (26 084)           |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :   |       |                    |                    |
| Charges à payer  |       | (84 733)           | (113 364)          |
| À payer sur achats d'investissements   |       | -                  | (188 135)          |
| <b>Total des passifs circulants</b>  |       | <b>(124 512)</b>   | <b>(327 583)</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>              |       | <b>253 433 722</b> | <b>341 275 764</b> |
|  |       | <b>2023</b>        | <b>2022</b>        |
|  |       | <b>2021</b>        |                    |
| Valeur liquidative par action  |       |                    |                    |
| Catégorie non couverte en USD (Acc)  | 5     | 17,43 USD          | 22,28 USD          |
| Catégorie non couverte en USD (Dist)   | 5     | 31,52 USD          | 41,46 USD          |
|  |       | 18,91 USD          | 35,93 USD          |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD         | 2022<br>USD       |
|--|-------|---------------------|-------------------|
| Produits de dividendes   |       | 10 394 571          | 9 620 671         |
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur   |       | 655                 | -                 |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat                 | 9     | (76 387 456)        | 39 316 864        |
| Produits divers  |       | 14 854              | -                 |
| <b>Total des (charges)/revenus d'investissement</b>  |       | <b>(65 977 376)</b> | <b>48 937 535</b> |
| Charges opérationnelles  | 3     | (1 015 993)         | (1 229 103)       |
| <b>(Perte)/Bénéfice net(te) pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(66 993 369)</b> | <b>47 708 432</b> |
| <b>Charges financières</b>   |       |                     |                   |
| Charges d'intérêts   |       | -                   | (3 830)           |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables  | 7     | (6 184 864)         | (5 867 570)       |
| <b>(Perte)/Bénéfice pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(73 178 233)</b> | <b>41 837 032</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement  | 2     | (2 330 518)         | (2 154 948)       |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(75 508 751)</b> | <b>39 682 084</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | 2023<br>USD         | 2022<br>USD        |
|--|---------------------|--------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier                              | 341 275 764         | 245 380 426        |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(75 508 751)</b> | <b>39 682 084</b>  |
| <b>Opérations sur actions</b>  |                     |                    |
| Produits sur actions de participation rachetables émises   | 81 660 706          | 120 724 767        |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables   | (93 993 997)        | (64 511 513)       |
| (Diminution)/Augmentation des actifs nets résultant d'opérations sur actions   | (12 333 291)        | 56 213 254         |
| <b>(Diminution)/Augmentation totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                   | <b>(87 842 042)</b> | <b>95 895 338</b>  |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>                       | <b>253 433 722</b>  | <b>341 275 764</b> |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

| Notes  | 2023<br>USD         | 2022<br>USD         |
|--|---------------------|---------------------|
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(75 508 751)</b> | <b>39 682 084</b>   |
| <b>Ajustement pour :</b>   |                     |                     |
| Variation de la trésorerie détenue par/à payer au courtier   | (122 102)           | 70 392              |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat   | 85 595 737          | (97 056 016)        |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés  | 136 862             | (150 542)           |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>  | <b>10 101 746</b>   | <b>(57 454 082)</b> |
| Variation des montants à recevoir  | 13 647              | (177 650)           |
| Variation des montants à payer   | (28 631)            | 32 352              |
| <b>Sorties de trésorerie sur opérations</b>  | <b>(14 984)</b>     | <b>(145 298)</b>    |
| <b>Entrées/(Sorties) de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>   | <b>10 086 762</b>   | <b>(57 599 380)</b> |
| <b>Activités de financement</b>  |                     |                     |
| Produits des souscriptions   | 5 81 660 706        | 120 724 767         |
| Paiements sur rachats  | 5 (93 993 997)      | (64 511 513)        |
| <b>Trésorerie nette (utilisée)/générée sur activités de financement</b>  | <b>(12 333 291)</b> | <b>56 213 254</b>   |
| <b>Diminution nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>  | <b>(2 246 529)</b>  | <b>(1 386 126)</b>  |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier   | 2 943 691           | 4 329 817           |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>  | <b>697 162</b>      | <b>2 943 691</b>    |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie – État de la situation financière  | 736 941             | 2 943 691           |
| Découverts bancaires – État de la situation financière   | (39 779)            | -                   |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie – État des flux de trésorerie</b>   | <b>697 162</b>      | <b>2 943 691</b>    |
| <b>Informations supplémentaires</b>  |                     |                     |
| Impôts payés   | (2 330 518)         | (2 154 948)         |
| Intérêts reçus   | 655                 | -                   |
| Intérêts payés   | -                   | (3 830)             |
| Dividendes reçus   | 10 408 218          | 9 443 021           |
| Distributions payées   | (6 184 864)         | (5 867 570)         |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                              | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,32 % (mars 2022 : 98,89 %)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 7,97 % (mars 2022 : 8,61 %)</b>   |                  |                   |
| <b>Réal brésilien – 0,27 %</b>                            |                  |                   |
| 83 312 Aliansce Sonae Shopping Centers sa                 | 289 195          | 0,11              |
| 1 166 BR Properties SA                                    | 53 900           | 0,02              |
| 32 503 Iguatemi   | 123 659          | 0,05              |
| 45 600 Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA          | 221 604          | 0,09              |
|   | <b>688 358</b>   | <b>0,27</b>       |
| <b>Dollar canadien – 0,13 %</b>                           |                  |                   |
| 20 005 First Capital Real Estate Investment Trust         | 232 518          | 0,09              |
| 9 281 Primaris Real Estate Investment Trust               | 92 649           | 0,04              |
|   | <b>325 167</b>   | <b>0,13</b>       |
| <b>Euro – 0,74 %</b>                                      |                  |                   |
| 180 515 Aroundtown SA                                     | 257 506          | 0,10              |
| 9 055 CA Immobilien Anlagen AG                            | 243 978          | 0,10              |
| 8 494 Deutsche Wohnen SE                                  | 166 940          | 0,07              |
| 34 917 Kojamo Oyj   | 411 601          | 0,16              |
| 14 332 LEG Immobilien SE                                  | 786 024          | 0,31              |
|   | <b>1 866 049</b> | <b>0,74</b>       |
| <b>Dollar de Hong Kong – 1,30 %</b>                       |                  |                   |
| 361 887 Hang Lung Properties Ltd                          | 676 756          | 0,27              |
| 118 000 Hysan Development Co Ltd                          | 335 212          | 0,13              |
| 207 000 Swire Properties Ltd                              | 532 666          | 0,21              |
| 305 000 Wharf Real Estate Investment Co Ltd               | 1 752 304        | 0,69              |
|   | <b>3 296 938</b> | <b>1,30</b>       |
| <b>Nouveau shekel israélien – 0,16 %</b>                  |                  |                   |
| 7 116 Azrieli Group Ltd                                   | 406 725          | 0,16              |
|   | <b>406 725</b>   | <b>0,16</b>       |
| <b>Yen japonais – 1,86 %</b>                              |                  |                   |
| 18 749 Aeon Mall Co Ltd                                   | 244 699          | 0,10              |
| 116 047 Hulic Co Ltd                                      | 947 803          | 0,37              |
| 188 282 Mitsui Fudosan                                    | 3 514 107        | 1,39              |
|   | <b>4 706 609</b> | <b>1,86</b>       |
| <b>Peso mexicain – 0,16 %</b>                             |                  |                   |
| 129 744 Corp Inmobiliaria Vesta SAB de CV                 | 406 923          | 0,16              |
|   | <b>406 923</b>   | <b>0,16</b>       |
| <b>Livre sterling – 0,17 %</b>                            |                  |                   |
| 146 307 Grainger PLC                                      | 421 500          | 0,17              |
|   | <b>421 500</b>   | <b>0,17</b>       |
| <b>Riyal saoudien – 0,06 %</b>                            |                  |                   |
| 27 054 Arabian Centres Co Ltd                             | 146 885          | 0,06              |
|   | <b>146 885</b>   | <b>0,06</b>       |
| <b>Dollar de Singapour – 0,52 %</b>                       |                  |                   |
| 479 736 Capitaland Investment Ltd/Singapore               | 1 327 839        | 0,52              |
|   | <b>1 327 839</b> | <b>0,52</b>       |

| Participation Investissement                                    | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,32 % (mars 2022 : 98,89 %)</b>       |                  |                   |
| <b>(suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 7,97 % (mars 2022 : 8,61 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Rand sud-africain – 0,21 %</b>                               |                  |                   |
| 93 146 NEPI Rockcastle NV                                       | 542 365          | 0,21              |
|   | <b>542 365</b>   | <b>0,21</b>       |
| <b>Couronne suédoise – 1,16 %</b>                               |                  |                   |
| 54 333 Castellum AB   | 630 856          | 0,25              |
| 53 254 Fabega AB  | 408 898          | 0,16              |
| 23 266 Hufvudstaden AB  | 315 686          | 0,12              |
| 20 394 Neobo Fastigheter AB                                     | 24 545           | 0,01              |
| 36 839 Sagax AB   | 848 364          | 0,34              |
| 221 109 Samhallsbyggnadsbolaget I Norden AB (Class B)           | 301 506          | 0,12              |
| 54 041 Wihlborgs Fastigheter AB                                 | 413 533          | 0,16              |
|   | <b>2 943 388</b> | <b>1,16</b>       |
| <b>Franc suisse – 0,90 %</b>                                    |                  |                   |
| 9 013 PSP Swiss Property AG                                     | 1 026 054        | 0,40              |
| 15 113 Swiss Prime Site AG                                      | 1 258 107        | 0,50              |
|   | <b>2 284 161</b> | <b>0,90</b>       |
| <b>Baht thaïlandais – 0,19 %</b>                                |                  |                   |
| 241 755 Central Pattana PCL                                     | 486 055          | 0,19              |
|   | <b>486 055</b>   | <b>0,19</b>       |
| <b>Dollar américain – 0,14 %</b>                                |                  |                   |
| 28 866 DigitalBridge Group Inc                                  | 346 103          | 0,14              |
|   | <b>346 103</b>   | <b>0,14</b>       |
| <b>Total des actions ordinaires</b>                             |                  |                   |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 91,35 %</b>  |                  |                   |
| <b>(mars 2022 : 90,28 %)</b>                                    |                  |                   |
| <b>Dollar australien – 2,78 %</b>                               |                  |                   |
| 93 346 BVP Trust  | 236 320          | 0,09              |
| 112 629 Centuria Industrial REIT                                | 226 300          | 0,09              |
| 124 829 Charter Hall Long Wale REIT                             | 350 302          | 0,14              |
| 100 519 Charter Hall Retail REIT                                | 253 133          | 0,10              |
| 210 734 Dexus   | 1 059 955        | 0,42              |
| 375 145 GPT Group   | 1 065 315        | 0,42              |
| 240 282 National Storage REIT                                   | 403 932          | 0,16              |
| 223 869 Region RE Ltd   | 352 350          | 0,14              |
| 1 017 648 Scentre Group   | 1 874 317        | 0,74              |
| 757 429 Vicinity Ltd  | 986 676          | 0,39              |
| 131 784 Waypoint REIT Ltd                                       | 228 599          | 0,09              |
|   | <b>7 037 199</b> | <b>2,78</b>       |
| <b>Dollar canadien – 1,06 %</b>                                 |                  |                   |
| 11 111 Artis Real Estate Investment Trust                       | 62 478           | 0,03              |
| 4 500 Boardwalk Real Estate Investment Trust                    | 183 345          | 0,07              |
| 16 773 Canadian Apartment Properties REIT                       | 587 585          | 0,23              |
| 23 861 Dream Industrial Real Estate Investment Trust            | 259 177          | 0,10              |

## SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|--|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,32 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b>                            |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,32 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b>                            |                   |                   |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 91,35 % (mars 2022 : 90,28 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 91,35 % (mars 2022 : 90,28 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Dollar canadien – 1,06 % (suite)</b>  |                  |                   | <b>Yen japonais – 7,57 % (suite)</b>   |                   |                   |
| 6 145 Granite Real Estate Investment Trust   | 380 001          | 0,15              | 1 371 Japan Metropolitan Fund Invest   | 996 136           | 0,39              |
| 24 909 H&R Real Estate Investment Trust  | 231 909          | 0,09              | 190 Japan Prime Realty Investment Corp   | 498 234           | 0,20              |
| 13 980 InterRent Real Estate Investment Trust  | 138 318          | 0,05              | 262 Japan Real Estate Investment Corp  | 1 039 417         | 0,41              |
| 22 349 NorthWest Healthcare Properties Real Estate Investment Trust                          | 139 872          | 0,06              | 164 Kenedix Office Investment Corp   | 377 684           | 0,15              |
| 28 851 RioCan Real Estate Investment Trust   | 434 678          | 0,17              | 208 Kenedix Residential Next Investment Corp   | 320 072           | 0,13              |
| 13 696 SmartCentres Real Estate Investment Trust   | 268 890          | 0,11              | 112 Kenedix Retail REIT Corp   | 197 677           | 0,08              |
|  | <b>2 686 253</b> | <b>1,06</b>       | 350 LaSalle Logiport REIT  | 404 200           | 0,16              |
|  |                  |                   | 108 Mitsubishi Estate Logistics REIT Investment Corp   | 316 883           | 0,12              |
| <b>Euro – 2,60 %</b>   |                  |                   | 112 Mitsui Fudosan Logistics Park Inc  | 391 314           | 0,15              |
| 8 066 Aedifica SA  | 649 361          | 0,26              | 320 Mori Hills REIT Investment Corp  | 354 888           | 0,14              |
| 5 828 Cofinimmo SA   | 516 361          | 0,20              | 487 Mori Trust Sogo Reit Inc   | 250 654           | 0,10              |
| 9 339 Covivio  | 543 845          | 0,21              | 99 Nippon Accommodations Fund Inc  | 444 083           | 0,17              |
| 10 704 Gecina SA   | 1 111 185        | 0,44              | 334 Nippon Building Fund Inc   | 1 382 779         | 0,55              |
| 51 554 Immobiliaria Colonial Socimi SA   | 326 263          | 0,13              | 551 Nippon Prologis REIT Inc   | 1 160 458         | 0,46              |
| 38 347 Klepierre SA  | 868 655          | 0,34              | 92 NIPPON REIT Investment Corp   | 221 204           | 0,09              |
| 65 730 Merlin Properties Socimi SA   | 575 583          | 0,23              | 925 Nomura Real Estate Master Fund Inc   | 1 032 102         | 0,41              |
| 21 126 Unibail-Rodamco-Westfield   | 1 133 501        | 0,45              | 266 NTT UD REIT Investment Corp  | 269 618           | 0,11              |
| 29 520 Warehouses De Pauw CVA  | 876 207          | 0,34              | 542 Orix JREIT Inc   | 684 169           | 0,27              |
|  | <b>6 600 961</b> | <b>2,60</b>       | 887 Sekisui House Reit Inc   | 479 189           | 0,19              |
| <b>Dollar de Hong Kong – 1,24 %</b>  |                  |                   | 170 Tokyu REIT Inc   | 231 197           | 0,09              |
| 486 843 Link REIT  | 3 131 940        | 1,24              | 611 United Urban Investment Corp   | 656 496           | 0,26              |
|  | <b>3 131 940</b> | <b>1,24</b>       |  | <b>19 188 800</b> | <b>7,57</b>       |
| <b>Yen japonais – 7,57 %</b>   |                  |                   | <b>Peso mexicain – 0,30 %</b>  |                   |                   |
| 138 Activia Properties Inc   | 391 945          | 0,15              | 554 612 Fibra Uno Administracion SA de CV  | 773 127           | 0,30              |
| 263 Advance Residence Investment Corp  | 625 438          | 0,25              |  | <b>773 127</b>    | <b>0,30</b>       |
| 333 AEON REIT Investment Corp  | 362 549          | 0,14              | <b>Livre sterling – 3,83 %</b>   |                   |                   |
| 128 Comforia Residential REIT Inc  | 303 434          | 0,12              | 581 736 Assura PLC   | 351 444           | 0,14              |
| 424 Daiwa House REIT Investment Corp   | 864 948          | 0,34              | 33 052 Big Yellow Group PLC  | 477 737           | 0,19              |
| 54 Daiwa Office Investment Corp  | 245 879          | 0,10              | 184 683 British Land Co PLC  | 885 546           | 0,35              |
| 445 Daiwa Securities Living Investments Corp   | 364 118          | 0,14              | 22 166 Derwent London PLC  | 646 261           | 0,26              |
| 100 Frontier Real Estate Investment Corp   | 356 901          | 0,14              | 50 293 Great Portland Estates PLC  | 315 277           | 0,12              |
| 188 Global One Real Estate Investment Corp   | 147 614          | 0,06              | 686 759 Hammerson PLC  | 221 541           | 0,09              |
| 889 GLP J-Reit   | 955 864          | 0,38              | 147 690 Land Securities Group PLC  | 1 134 381         | 0,45              |
| 54 Hoshino Resorts REIT Inc  | 279 961          | 0,11              | 185 358 LondonMetric Property PLC  | 402 451           | 0,16              |
| 251 Hulic Reit Inc   | 282 137          | 0,11              | 336 430 LXI REIT PLC   | 409 323           | 0,16              |
| 282 Ichigo Office REIT Investment Corp   | 205 106          | 0,08              | 271 945 Primary Health Properties PLC  | 340 281           | 0,13              |
| 426 Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp   | 461 561          | 0,18              | 39 879 Safestore Holdings PLC  | 468 430           | 0,18              |
| 1 216 Invincible Investment Corp   | 508 913          | 0,20              | 233 811 Segro PLC  | 2 219 098         | 0,88              |
| 239 Japan Excellent Inc  | 215 314          | 0,08              | 248 386 Supermarket Income Reit PLC  | 265 963           | 0,10              |
| 877 Japan Hotel REIT Investment Corp   | 494 873          | 0,20              | 368 482 Tritax Big Box REIT PLC  | 637 398           | 0,25              |
| 187 Japan Logistics Fund Inc   | 413 791          | 0,16              | 78 588 UNITE Group PLC   | 932 348           | 0,37              |
|  |                  |                   |  | <b>9 707 479</b>  | <b>3,83</b>       |



## SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,32 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b>                            |                  |                   |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 91,35 % (mars 2022 : 90,28 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar de Singapour – 2,97 %</b>  |                  |                   |
| 663 077 CapitalLand Ascendas REIT  | 1 426 347        | 0,56              |
| 386 900 CapitalLand Ascott Trust   | 289 546          | 0,12              |
| 223 300 CapitalLand China Trust  | 188 106          | 0,08              |
| 985 806 CapitalLand Integrated Commercial Trust  | 1 468 088        | 0,58              |
| 213 296 Frasers Centrepoint Trust  | 367 378          | 0,15              |
| 576 600 Frasers Logistics & Commercial Trust   | 568 122          | 0,22              |
| 259 700 Keppel DC REIT   | 402 378          | 0,16              |
| 389 156 Keppel REIT  | 259 037          | 0,10              |
| 385 090 Mapletree Industrial Trust   | 686 445          | 0,27              |
| 632 701 Mapletree Logistics Trust  | 813 748          | 0,32              |
| 432 750 Mapletree Pan Asia Commercial Trust  | 585 875          | 0,23              |
| 431 750 Suntec Real Estate Investment Trust  | 464 370          | 0,18              |
|  | <b>7 519 440</b> | <b>2,97</b>       |
| <b>Rand sud-africain – 0,18 %</b>  |                  |                   |
| 617 548 Growthpoint Properties Ltd   | 454 568          | 0,18              |
|  | <b>454 568</b>   | <b>0,18</b>       |
| <b>Dollar américain – 68,82 %</b>  |                  |                   |
| 17 690 Acadia Realty Trust   | 246 776          | 0,10              |
| 17 635 Agree Realty Corp   | 1 209 937        | 0,48              |
| 30 800 Alexandria Real Estate Equities Inc   | 3 868 172        | 1,53              |
| 10 441 American Assets Trust Inc   | 1 904 098        | 0,08              |
| 60 437 American Homes 4 Rent   | 1 900 744        | 0,75              |
| 52 974 Americold Realty Trust Inc  | 1 507 110        | 0,59              |
| 29 161 Apartment Income REIT Corp  | 1 044 255        | 0,41              |
| 27 965 Apartment Investment and Management Co  | 215 051          | 0,08              |
| 41 918 Apple Hospitality REIT Inc  | 650 567          | 0,26              |
| 7 842 Ashford Hospitality Trust Inc  | 25 173           | 0,01              |
| 27 346 AvalonBay Communities   | 4 595 769        | 1,81              |
| 27 991 Boston Properties   | 1 514 873        | 0,60              |
| 37 228 Brandywine Realty Trust   | 176 088          | 0,07              |
| 58 974 Brixmor Property Group Inc  | 1 269 121        | 0,50              |
| 33 889 Broadstone Net Lease Inc  | 576 452          | 0,23              |
| 20 980 Camden Property Trust   | 2 199 543        | 0,87              |
| 20 167 CareTrust REIT Inc  | 394 870          | 0,16              |
| 3 110 Centerspace  | 169 899          | 0,07              |
| 11 400 Chatham Lodging Trust   | 119 586          | 0,05              |
| 10 396 City Office REIT Inc  | 71 732           | 0,03              |
| 4 808 Community Healthcare Trust Inc   | 175 973          | 0,07              |
| 22 149 Corporate Office Properties Trust   | 525 153          | 0,21              |
| 30 444 Cousins Properties Inc  | 650 893          | 0,26              |
| 44 285 CubeSmart   | 2 046 853        | 0,81              |
| 43 461 DiamondRock Hospitality Co  | 353 338          | 0,14              |

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,32 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b>                            |                  |                   |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 91,35 % (mars 2022 : 90,28 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 68,82 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 56 194 Digital Realty Trust Inc  | 5 524 432        | 2,18              |
| 47 005 Diversified Healthcare Trust  | 63 457           | 0,02              |
| 34 584 Douglas Emmett Inc  | 426 421          | 0,17              |
| 18 454 Easterly Government Properties Inc  | 253 558          | 0,10              |
| 8 617 EastGroup Properties Inc   | 1 424 562        | 0,56              |
| 16 494 Elme Communities  | 294 583          | 0,12              |
| 26 147 Empire State Realty Trust Inc   | 169 694          | 0,07              |
| 14 708 EPR Properties  | 560 375          | 0,22              |
| 18 178 Equinix Inc   | 13 107 065       | 5,17              |
| 21 437 Equity Commonwealth   | 443 960          | 0,17              |
| 34 078 Equity LifeStyle Properties Inc   | 2 287 656        | 0,90              |
| 66 246 Equity Residential  | 3 974 760        | 1,57              |
| 28 679 Essential Properties Realty Trust Inc   | 712 673          | 0,28              |
| 12 676 Essex Property Trust Inc  | 2 651 059        | 1,05              |
| 26 143 Extra Space Storage Inc   | 4 259 479        | 1,68              |
| 14 475 Federal Realty Investment Trust   | 1 430 564        | 0,56              |
| 25 967 First Industrial Realty Trust Inc   | 1 381 444        | 0,54              |
| 17 249 Four Corners Property Trust Inc   | 463 308          | 0,18              |
| 26 213 Franklin Street Properties Corp   | 41 154           | 0,02              |
| 8 292 Getty Realty Corp  | 298 761          | 0,12              |
| 14 289 Global Medical REIT Inc   | 130 173          | 0,05              |
| 20 309 Global Net Lease Inc  | 261 174          | 0,10              |
| 74 544 Healthcare Realty Trust Inc   | 1 440 936        | 0,57              |
| 105 663 Healthpeak Properties Inc  | 2 321 416        | 0,92              |
| 6 973 Hersha Hospitality Trust   | 46 859           | 0,02              |
| 20 740 Highwoods Properties Inc  | 480 961          | 0,19              |
| 140 523 Host Hotels & Resorts Inc  | 2 317 224        | 0,91              |
| 25 309 Hudson Pacific Properties Inc   | 168 305          | 0,07              |
| 44 920 Independence Realty Trust Inc   | 720 068          | 0,28              |
| 18 882 Industrial Logistics Properties Trust   | 57 968           | 0,02              |
| 5 497 Innovative Industrial Properties Inc   | 417 717          | 0,16              |
| 113 862 Invitation Homes Inc   | 3 555 910        | 1,40              |
| 19 618 JBG SMITH Properties  | 295 447          | 0,12              |
| 20 698 Kilroy Realty Corp  | 670 615          | 0,26              |
| 121 619 Kimco Realty Corp  | 2 375 219        | 0,94              |
| 43 118 Kite Realty Group Trust   | 902 029          | 0,36              |
| 16 713 Life Storage Inc  | 2 190 907        | 0,86              |
| 7 922 LTC Properties Inc   | 278 300          | 0,11              |
| 55 988 LXP Industrial Trust  | 577 236          | 0,23              |
| 43 739 Macerich Co   | 463 633          | 0,18              |
| 118 532 Medical Properties Trust Inc   | 974 333          | 0,38              |
| 22 539 Mid-America Apartment Communities Inc   | 3 404 291        | 1,34              |
| 8 699 National Health Investors Inc  | 448 694          | 0,18              |

## SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,32 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b>                            |                  |                   |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 91,35 % (mars 2022 : 90,28 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 68,82 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 35 354 National Retail Properties Inc  | 1 560 879        | 0,62              |
| 16 602 National Storage Affiliates Trust   | 693 632          | 0,27              |
| 24 345 Necessity Retail REIT Inc   | 152 887          | 0,06              |
| 10 712 NETSTREIT Corp  | 195 815          | 0,08              |
| 4 669 NexPoint Residential Trust Inc   | 203 895          | 0,08              |
| 10 121 Office Properties Income Trust  | 124 488          | 0,05              |
| 46 444 Omega Healthcare Investors Inc  | 1 273 030        | 0,50              |
| 13 829 Orion Office REIT Inc   | 92 654           | 0,04              |
| 36 374 Paramount Group Inc   | 165 865          | 0,06              |
| 43 991 Park Hotels & Resorts Inc   | 543 729          | 0,21              |
| 25 738 Pebblebrook Hotel Trust   | 361 362          | 0,14              |
| 24 337 Piedmont Office Realty Trust Inc  | 177 660          | 0,07              |
| 7 641 Plymouth Industrial REIT Inc   | 160 537          | 0,06              |
| 180 657 Prologis Inc   | 22 540 574       | 8,89              |
| 31 036 Public Storage  | 9 377 217        | 3,70              |
| 122 296 Realty Income  | 7 743 783        | 3,05              |
| 30 188 Regency Centers Corp  | 1 846 902        | 0,73              |
| 24 710 Retail Opportunity Investments Corp   | 344 952          | 0,14              |
| 37 041 Rexford Industrial Realty Inc   | 2 209 496        | 0,87              |
| 32 799 RLJ Lodging Trust   | 347 669          | 0,14              |
| 16 887 RPT Realty  | 160 595          | 0,06              |
| 10 826 Ryman Hospitality Properties Inc  | 971 417          | 0,38              |
| 9 271 Seritage Growth Properties   | 72 963           | 0,03              |
| 34 045 Service Properties Trust  | 339 088          | 0,13              |
| 63 807 Simon Property Group  | 7 144 470        | 2,82              |
| 37 818 SITE Centers Corp   | 464 405          | 0,18              |
| 13 163 SL Green Realty Corp  | 309 594          | 0,12              |
| 27 780 Spirit Realty Capital Inc   | 1 106 755        | 0,44              |
| 35 652 STAG Industrial Inc   | 1 205 751        | 0,48              |
| 20 976 Summit Hotel Properties Inc   | 146 832          | 0,06              |
| 24 293 Sun Communities Inc   | 3 422 398        | 1,35              |
| 42 291 Sunstone Hotel Investors Inc  | 417 835          | 0,16              |
| 20 491 Tanger Factory Outlet Centers Inc   | 402 238          | 0,16              |
| 14 154 Terreno Realty Corp   | 914 348          | 0,36              |
| 59 824 UDR Inc   | 2 456 373        | 0,97              |
| 11 514 UMH Properties Inc  | 170 292          | 0,07              |
| 2 449 Universal Health Realty Income Trust   | 117 821          | 0,05              |
| 23 043 Urban Edge Properties   | 347 028          | 0,14              |
| 78 080 Ventas Inc  | 3 384 768        | 1,34              |
| 15 951 Veris Residential Inc   | 233 523          | 0,09              |
| 32 494 Vornado Realty Trust  | 499 433          | 0,20              |
| 92 160 Welltower Inc   | 6 606 950        | 2,61              |
| 40 676 WP Carey Inc  | 3 150 356        | 1,24              |

| Participation Investissement   | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|--|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,32 % (mars 2022 : 98,89 %) (suite)</b>                            |                    |                   |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 91,35 % (mars 2022 : 90,28 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Dollar américain – 68,82 % (suite)</b>  |                    |                   |
| 22 483 Xenia Hotels & Resorts Inc  | 294 302            | 0,12              |
|  | <b>174 426 967</b> | <b>68,82</b>      |
| <b>Total des fiducies de placement immobilier de type REIT</b>                               | <b>231 526 734</b> | <b>91,35</b>      |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>  | <b>251 721 799</b> | <b>99,32</b>      |

**Instruments financiers dérivés – 0,01 % (mars 2022 : 0,05 %)**

**Contrats à terme standardisés – 0,01 % (mars 2022 : 0,05 %)**

| Montant notionnel | Prix du coût moyen   | Plus-values latentes USD | % des actifs nets |
|-------------------|--|--------------------------|-------------------|
| 1 135 168         | 324 35 of DJ US Real Estate Index Futures Long Contracts Expiring 16 June 2023 | 24 382                   | 0,01              |
|                   | <b>Plus-values latentes nettes sur contrats à terme standardisés</b>           | <b>24 382</b>            | <b>0,01</b>       |
|                   | <b>Total des instruments financiers dérivés</b>                                | <b>24 382</b>            | <b>0,01</b>       |

|   | Juste valeur USD   | % du Comp.    |
|---|--------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | 251 746 181        | 99,33         |
| <b>Disponibilités bancaires (mars 2022 : 0,86 %)</b>                                | 736 941            | 0,29          |
| <b>Liquidités détenues auprès d'un courtier* (mars 2022 : néant)</b>                | 96 018             | 0,04          |
| <b>Découverts bancaires (mars 2022 : néant)</b>                                     | (39 779)           | (0,02)        |
| <b>Montants à recevoir du courtier (mars 2022 : (0,01 %))</b>                       | -                  | -             |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : 0,21 %)</b>                                      | 894 361            | 0,36          |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>253 433 722</b> | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company, à l'exception des liquidités détenues auprès d'un courtier, en l'occurrence Goldman Sachs.

Le courtier pour les contrats à terme standardisés ouverts est Goldman Sachs.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

## SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                        | <b>% du total des actifs</b> |
|---|------------------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs | 99,28                        |
| Instruments financiers dérivés négociés en Bourse                       | 0,01                         |
| Autres actifs   | 0,71                         |
| <b>Total des actifs</b>   | <b>100,00</b>                |

## SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>EUR       | 2022<br>EUR       |
|---|-------|-------------------|-------------------|
| <b>Actifs circulants</b>  |       |                   |                   |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :            |       |                   |                   |
| Valeurs mobilières  | 1(e)  | 33 845 760        | 61 753 223        |
|   |       | <b>33 845 760</b> | <b>61 753 223</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie   | 1(f)  | 171 793           | 134 540           |
| Créances :  |       |                   |                   |
| Dividendes à recevoir   |       | 211 185           | 172 895           |
| À recevoir sur cessions d'investissements   |       | 10 819            | -                 |
| <b>Total des actifs circulants</b>  |       | <b>34 239 557</b> | <b>62 060 658</b> |
| <b>Passifs circulants</b>   |       |                   |                   |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :  |       |                   |                   |
| Charges à payer   |       | (9 306)           | (15 531)          |
| <b>Total des passifs circulants</b>   |       | <b>(9 306)</b>    | <b>(15 531)</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> |       | <b>34 230 251</b> | <b>62 045 127</b> |
|   |       | <b>2023</b>       | <b>2022</b>       |
|   |       | <b>2021</b>       |                   |
| Valeur liquidative par action   | 5     | 21,61 EUR         | 34,59 EUR         |
|   |       |                   | 31,91 EUR         |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>EUR         | 2022<br>EUR      |
|--|-------|---------------------|------------------|
| Produits de dividendes   |       | 1 840 686           | 1 687 784        |
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur   |       | 5                   | -                |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat                 | 9     | (23 310 606)        | 3 958 942        |
| Produits divers  |       | 621                 | 42               |
| <b>Total des (charges)/revenus d'investissement</b>  |       | <b>(21 469 294)</b> | <b>5 646 768</b> |
| Charges opérationnelles  | 3     | (124 081)           | (193 342)        |
| <b>(Perte)/Bénéfice net(te) pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(21 593 375)</b> | <b>5 453 426</b> |
| <b>Charges financières</b>   |       |                     |                  |
| Charges d'intérêts   |       | (583)               | (1 682)          |
| <b>(Perte)/Bénéfice pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(21 593 958)</b> | <b>5 451 744</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement  | 2     | (149 415)           | (144 186)        |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(21 743 373)</b> | <b>5 307 558</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | 2023<br>EUR         | 2022<br>EUR       |
|--|---------------------|-------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier                              | 62 045 127          | 59 481 064        |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(21 743 373)</b> | <b>5 307 558</b>  |
| <b>Opérations sur actions</b>  |                     |                   |
| Produits sur actions de participation rachetables émises   | 7 563 993           | 1 010 929         |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables   | (13 635 496)        | (3 754 424)       |
| Diminution des actifs nets résultant d'opérations sur actions  | (6 071 503)         | (2 743 495)       |
| <b>(Diminution)/Augmentation totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                   | <b>(27 814 876)</b> | <b>2 564 063</b>  |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>                       | <b>34 230 251</b>   | <b>62 045 127</b> |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>EUR         | 2022<br>EUR        |
|--|-------|---------------------|--------------------|
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(21 743 373)</b> | <b>5 307 558</b>   |
| <b>Ajustement pour :</b>   |       |                     |                    |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat   |       | 27 896 644          | (2 682 446)        |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>  |       | <b>6 153 271</b>    | <b>2 625 112</b>   |
| Variation des montants à recevoir  |       | (38 290)            | 112 710            |
| Variation des montants à payer   |       | (6 225)             | (123)              |
| <b>(Sorties)/Entrées de trésorerie sur opérations</b>  |       | <b>(44 515)</b>     | <b>112 587</b>     |
| <b>Entrées de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>   |       | <b>6 108 756</b>    | <b>2 737 699</b>   |
| <b>Activités de financement</b>  |       |                     |                    |
| Produits des souscriptions   | 5     | 7 563 993           | 1 010 929          |
| Paiements sur rachats  | 5     | (13 635 496)        | (3 754 424)        |
| <b>Trésorerie nette utilisée sur activités de financement</b>  |       | <b>(6 071 503)</b>  | <b>(2 743 495)</b> |
| <b>Augmentation/(Diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>   |       | <b>37 253</b>       | <b>(5 796)</b>     |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier   |       | 134 540             | 140 336            |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>  |       | <b>171 793</b>      | <b>134 540</b>     |
| <b>Informations supplémentaires</b>  |       |                     |                    |
| Impôts payés   |       | (149 415)           | (144 186)          |
| Intérêts reçus   |       | 5                   | -                  |
| Intérêts payés   |       | (583)               | (1 682)            |
| Dividendes reçus   |       | 1 802 396           | 1 800 494          |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                              | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,88 % (mars 2022 : 99,53 %)</b> |                     |                         |
| <b>Actions ordinaires – 58,73 % (mars 2022 : 68,44 %)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 22,72 %</b>                                     |                     |                         |
| 31 823 ADLER Group SA                                     | 28 768              | 0,08                    |
| 217 308 Aroundtown SA                                     | 285 325             | 0,83                    |
| 13 293 CA Immobilien Anlagen AG                           | 329 666             | 0,96                    |
| 22 697 Citycon Oyj  | 142 878             | 0,42                    |
| 3 778 Deutsche EuroShop AG                                | 72 802              | 0,21                    |
| 15 762 Deutsche Wohnen SE                                 | 285 135             | 0,83                    |
| 16 526 DIC Asset AG                                       | 130 721             | 0,38                    |
| 29 971 Grand City Properties SA                           | 195 860             | 0,57                    |
| 61 655 Kojamo Oyj   | 668 957             | 1,96                    |
| 23 517 LEG Immobilien SE                                  | 1 187 138           | 3,47                    |
| 47 472 TAG Immobilien AG                                  | 302 634             | 0,89                    |
| 3 188 VGP NV  | 262 054             | 0,77                    |
| 224 085 Vonovia SE  | 3 885 634           | 11,35                   |
|   | <b>7 777 572</b>    | <b>22,72</b>            |
| <b>Couronne norvégienne – 0,44 %</b>                      |                     |                         |
| 17 029 Entra ASA  | 151 306             | 0,44                    |
|   | <b>151 306</b>      | <b>0,44</b>             |
| <b>Couronne suédoise – 21,06 %</b>                        |                     |                         |
| 13 935 Atrium Ljungberg AB                                | 209 037             | 0,61                    |
| 81 273 Castellum AB                                       | 868 567             | 2,54                    |
| 10 480 Catena AB  | 357 209             | 1,04                    |
| 15 504 Cibus Nordic Real Estate AB                        | 149 040             | 0,43                    |
| 211 046 Corem Property Group AB                           | 135 533             | 0,40                    |
| 27 806 Dios Fastigheter AB                                | 169 931             | 0,50                    |
| 79 736 Fabega AB  | 563 517             | 1,65                    |
| 197 293 Fastighets AB Balder                              | 744 446             | 2,17                    |
| 33 757 Hufvudstaden AB                                    | 421 588             | 1,23                    |
| 8 713 NP3 Fastigheter AB                                  | 144 624             | 0,42                    |
| 57 141 Nyfosa AB  | 365 183             | 1,07                    |
| 28 243 Pandox AB  | 324 396             | 0,95                    |
| 17 354 Platzer Fastigheter Holding AB                     | 123 847             | 0,36                    |
| 54 393 Sagax AB   | 1 152 943           | 3,37                    |
| 353 632 Samhallsbyggnadsbolaget I Norden AB (Class B)     | 443 845             | 1,30                    |
| 4 631 Stendorren Fastigheter AB                           | 71 196              | 0,21                    |
| 107 173 Wallenstam AB                                     | 373 479             | 1,09                    |
| 83 847 Wihlborgs Fastigheter AB                           | 590 561             | 1,72                    |
|   | <b>7 208 942</b>    | <b>21,06</b>            |
| <b>Franc suisse – 14,51 %</b>                             |                     |                         |
| 4 611 Allreal Holding AG                                  | 716 370             | 2,09                    |
| 1 099 Hiag Immobilien Holding AG                          | 88 361              | 0,26                    |
| 340 Intershop Holding AG                                  | 228 145             | 0,67                    |
| 2 273 Mobimo Holding AG                                   | 545 047             | 1,59                    |
| 3 822 Peach Property Group AG                             | 47 134              | 0,14                    |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,88 % (mars 2022 : 99,53 %)</b>         |                     |                         |
| <b>(suite)</b>  |                     |                         |
| <b>Actions ordinaires – 58,73 % (mars 2022 : 68,44 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Franc suisse – 14,51 % (suite)</b>                             |                     |                         |
| 14 306 PSP Swiss Property AG                                      | 1 499 027           | 4,38                    |
| 24 042 Swiss Prime Site AG  | 1 842 162           | 5,38                    |
|   | <b>4 966 246</b>    | <b>14,51</b>            |
| <b>Total des actions ordinaires</b>                               |                     |                         |
|   | <b>20 104 066</b>   | <b>58,73</b>            |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 40,15 %</b>    |                     |                         |
| <b>(mars 2022 : 31,09 %)</b>                                      |                     |                         |
| <b>Euro – 40,15 %</b>   |                     |                         |
| 12 647 Aedifica SA  | 937 143             | 2,74                    |
| 3 096 ARGAN SA  | 213 314             | 0,62                    |
| 1 619 Ascencio  | 78 845              | 0,23                    |
| 18 170 Carmila SA   | 251 109             | 0,73                    |
| 10 421 Cofinimmo SA   | 849 833             | 2,48                    |
| 15 879 Covivio  | 851 114             | 2,49                    |
| 16 369 Eurocommercial Properties NV                               | 343 094             | 1,00                    |
| 16 362 Gecina SA  | 1 563 389           | 4,57                    |
| 22 128 Hamborner REIT AG  | 161 756             | 0,47                    |
| 3 053 Home Invest Belgium SA                                      | 62 983              | 0,18                    |
| 10 189 ICADE  | 441 591             | 1,29                    |
| 20 476 Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ SpA                  | 57 947              | 0,17                    |
| 107 532 Immobiliaria Colonial Socimi SA                           | 626 374             | 1,83                    |
| 8 294 Interinvest Offices & Warehouses NV                         | 145 145             | 0,42                    |
| 140 470 Irish Residential Properties REIT PLC                     | 130 637             | 0,38                    |
| 59 356 Klepierre SA   | 1 237 573           | 3,62                    |
| 18 730 Lar Espana Real Estate Socimi SA                           | 92 245              | 0,27                    |
| 27 793 Mercialys SA   | 261 532             | 0,76                    |
| 105 615 Merlin Properties Socimi SA                               | 851 257             | 2,49                    |
| 4 624 Montea NV   | 344 488             | 1,01                    |
| 211 Nextensa SA   | 8 366               | 0,03                    |
| 5 933 NSI NV  | 137 646             | 0,40                    |
| 3 535 Retail Estates NV   | 230 129             | 0,67                    |
| 8 028 Shurgard Self Storage Ltd                                   | 354 035             | 1,04                    |
| 32 476 Unibail-Rodamco-Westfield                                  | 1 603 827           | 4,69                    |
| 5 390 Vastned Retail NV   | 114 538             | 0,34                    |
| 49 224 Warehouses De Pauw CVA                                     | 1 344 800           | 3,93                    |
| 12 620 Wereldhave NV  | 179 330             | 0,52                    |
| 8 634 Xior Student Housing NV                                     | 267 654             | 0,78                    |
| <b>Total des fiducies de placement immobilier de type REIT</b>    |                     |                         |
|   | <b>13 741 694</b>   | <b>40,15</b>            |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>                               |                     |                         |
|   | <b>33 845 760</b>   | <b>98,88</b>            |



## SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

|   | Juste<br>valeur<br>EUR   | % du<br>Comp.        |
|---|--------------------------|----------------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | 33 845 760               | 98,88                |
| <b>Disponibilités bancaires*</b><br>(mars 2022 : 0,22 %)                                | 171 793                  | 0,50                 |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : 0,25 %)</b>  | <u>212 698</u>           | <u>0,62</u>          |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs<br/>d'actions de participation rachetables</b> | <b><u>34 230 251</u></b> | <b><u>100,00</u></b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

|   | % du<br>total<br>des actifs |
|---|-----------------------------|
| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                        |                             |
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs | 98,85                       |
| Autres actifs   | <u>1,15</u>                 |
| <b>Total des actifs</b>   | <b><u>100,00</u></b>        |

## SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>GBP         | 2022<br>GBP        |
|--|-------|---------------------|--------------------|
| <b>Actifs circulants</b>   |       |                     |                    |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                         |       |                     |                    |
|  | 1(e)  |                     |                    |
| Valeurs mobilières   |       | 672 893 868         | 658 193 865        |
| Instruments financiers dérivés   |       | 78 731              | 579 359            |
|  |       | <b>672 972 599</b>  | <b>658 773 224</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie  | 1(f)  | 12 588 155          | 7 264 850          |
| Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties à des instruments financiers ouverts | 1(g)  | 302 304             | 141 472            |
| Créances :   |       |                     |                    |
| Dividendes à recevoir  |       | 4 381 150           | 4 393 030          |
| <b>Total des actifs circulants</b>   |       | <b>690 244 208</b>  | <b>670 572 576</b> |
| <b>Passifs circulants</b>  |       |                     |                    |
| Découverts bancaires   | 1(f)  | (11 277)            | -                  |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :   |       |                     |                    |
| Charges à payer  |       | (119 872)           | (110 362)          |
| À payer sur achats d'investissements   |       | -                   | (9 878)            |
| À payer sur rachats d'actions de fonds   |       | (10 014 504)        | -                  |
| <b>Total des passifs circulants</b>  |       | <b>(10 145 653)</b> | <b>(120 240)</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>              |       | <b>680 098 555</b>  | <b>670 452 336</b> |
|  |       | <b>2023</b>         | <b>2022</b>        |
|  |       | <b>2021</b>         |                    |
| Valeur liquidative par action  |       |                     |                    |
| Catégorie non couverte en GBP (Acc)  | 5     | 59,69 GBP           | 58,12 GBP          |
| Catégorie non couverte en GBP (Dist)   | 5     | 5,00 GBP            | 5,06 GBP           |
|  |       |                     | 4,62 GBP           |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>GBP       | 2022<br>GBP       |
|---|-------|-------------------|-------------------|
| Produits de dividendes  |       | 24 638 317        | 26 736 181        |
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 5 719             | -                 |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat    | 9     | (7 807 787)       | 68 605 450        |
| Produits divers   |       | 13 920            | 18 640            |
| <b>Total des produits d'investissement</b>  |       | <b>16 850 169</b> | <b>95 360 271</b> |
| Charges opérationnelles   | 3     | (1 395 934)       | (1 502 129)       |
| <b>Bénéfice net pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>   |       | <b>15 454 235</b> | <b>93 858 142</b> |
| <b>Charges financières</b>  |       |                   |                   |
| Charges d'intérêts  |       | -                 | (7 497)           |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables   | 7     | (2 897 029)       | (2 779 387)       |
| <b>Bénéfice pour l'exercice financier avant impôt</b>   |       | <b>12 557 206</b> | <b>91 071 258</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement   | 2     | (111 776)         | (206 515)         |
| <b>Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>12 445 430</b> | <b>90 864 743</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>GBP        | 2022<br>GBP          |
|---|--------------------|----------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier                 | 670 452 336        | 807 561 197          |
| <b>Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>12 445 430</b>  | <b>90 864 743</b>    |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                    |                      |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 101 326 254        | 118 013 243          |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (104 125 465)      | (345 986 847)        |
| Diminution des actifs nets résultant d'opérations sur actions   | (2 799 211)        | (227 973 604)        |
| <b>Augmentation/(Diminution) totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>      | <b>9 646 219</b>   | <b>(137 108 861)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>          | <b>680 098 555</b> | <b>670 452 336</b>   |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

| Notes   | 2023<br>GBP        | 2022<br>GBP          |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>12 445 430</b>  | <b>90 864 743</b>    |
| <b>Ajustement pour :</b>  |                    |                      |
| Variation de la trésorerie détenue par/à payer au courtier  | (160 832)          | 615 027              |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | (14 709 881)       | 139 344 275          |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés   | 500 628            | (603 207)            |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   | <b>(1 924 655)</b> | <b>230 220 838</b>   |
| Variation des montants à recevoir   | 11 880             | (206 219)            |
| Variation des montants à payer  | 9 510              | (22 972)             |
| <b>Entrées/(Sorties) de trésorerie sur opérations</b>   | <b>21 390</b>      | <b>(229 191)</b>     |
| <b>(Sorties)/Entrées de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  | <b>(1 903 265)</b> | <b>229 991 647</b>   |
| <b>Activités de financement</b>   |                    |                      |
| Produits des souscriptions  | 5 101 326 254      | 118 013 243          |
| Paiements sur rachats   | 5 (94 110 961)     | (345 986 847)        |
| <b>Trésorerie nette générée/(utilisée) sur activités de financement</b>   | <b>7 215 293</b>   | <b>(227 973 604)</b> |
| <b>Augmentation nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>   | <b>5 312 028</b>   | <b>2 018 043</b>     |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  | 7 264 850          | 5 246 807            |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   | <b>12 576 878</b>  | <b>7 264 850</b>     |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie – État de la situation financière   | 12 588 155         | 7 264 850            |
| Découverts bancaires – État de la situation financière  | (11 277)           | -                    |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie – État des flux de trésorerie</b>  | <b>12 576 878</b>  | <b>7 264 850</b>     |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |                    |                      |
| Impôts payés  | (111 776)          | (206 515)            |
| Intérêts reçus  | 5 719              | -                    |
| Intérêts payés  | -                  | (7 497)              |
| Dividendes reçus  | 24 650 197         | 26 529 962           |
| Distributions payées  | (2 897 029)        | (2 779 387)          |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                              | Juste valeur<br>GBP | % des<br>actifs<br>nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur<br>GBP | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,17 %)</b> |                     |                         | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,17 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Actions ordinaires – 91,05 % (mars 2022 : 89,01 %)</b> |                     |                         | <b>Actions ordinaires – 91,05 % (mars 2022 : 89,01 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Livre sterling – 91,05 %</b>                           |                     |                         | <b>Livre sterling – 91,05 % (suite)</b>                           |                     |                         |
| 275 067 3i Group PLC                                      | 4 634 879           | 0,68                    | 76 822 Bridgepoint Group PLC                                      | 169 623             | 0,02                    |
| 7 604 4imprint Group PLC                                  | 366 893             | 0,05                    | 645 886 British American Tobacco PLC                              | 18 346 392          | 2,70                    |
| 93 868 888 Holdings PLC                                   | 48 483              | 0,01                    | 80 482 Britvic PLC  | 717 095             | 0,11                    |
| 106 927 Abrdn European Logistics Income PLC               | 73 031              | 0,01                    | 1 952 084 BT Group PLC  | 2 846 138           | 0,42                    |
| 628 772 abrdn PLC   | 1 279 551           | 0,19                    | 97 303 Bunzl PLC  | 2 974 553           | 0,44                    |
| 81 855 Admiral Group PLC                                  | 1 668 205           | 0,25                    | 111 935 Burberry Group PLC  | 2 894 639           | 0,43                    |
| 21 133 AG Barr PLC  | 106 510             | 0,02                    | 65 358 Bytes Technology Group PLC                                 | 253 850             | 0,04                    |
| 324 232 Airtel Africa PLC                                 | 345 307             | 0,05                    | 91 524 C&C Group PLC  | 143 784             | 0,02                    |
| 89 072 AJ Bell PLC  | 307 477             | 0,05                    | 505 113 Capita PLC  | 184 871             | 0,03                    |
| 27 218 Alfa Financial Software Holdings PLC               | 37 153              | 0,01                    | 68 904 Capital Ltd  | 67 939              | 0,01                    |
| 345 372 Anglo American PLC                                | 9 249 062           | 1,36                    | 89 611 Capricorn Energy PLC                                       | 209 152             | 0,03                    |
| 5 063 Anglo-Eastern Plantations PLC                       | 41 517              | 0,01                    | 70 982 Card Factory PLC   | 61 683              | 0,01                    |
| 103 165 Antofagasta                                       | 1 631 039           | 0,24                    | 44 857 Carnival PLC   | 329 340             | 0,05                    |
| 89 729 AO World PLC                                       | 57 875              | 0,01                    | 4 896 Carr's Group PLC  | 6 316               | 0,00                    |
| 18 705 Aptitude Software Group PLC                        | 70 144              | 0,01                    | 340 783 Centamin PLC  | 355 266             | 0,05                    |
| 113 733 Ascential PLC                                     | 274 097             | 0,04                    | 1 688 380 Centrica PLC  | 1 790 527           | 0,26                    |
| 117 315 Ashmore Group PLC                                 | 279 914             | 0,04                    | 80 890 Chemring Group PLC   | 224 874             | 0,03                    |
| 125 212 Ashtead Group                                     | 6 208 011           | 0,91                    | 41 856 Chesnara PLC   | 125 568             | 0,02                    |
| 20 371 ASOS PLC   | 167 144             | 0,02                    | 127 892 Chrysalis Investments Ltd                                 | 75 073              | 0,01                    |
| 100 094 Associated British Foods PLC                      | 1 941 824           | 0,29                    | 7 398 Clarkson PLC  | 228 598             | 0,03                    |
| 123 379 Aston Martin Lagonda Global Holdings PLC          | 281 674             | 0,04                    | 46 189 Close Brothers Group PLC                                   | 416 163             | 0,06                    |
| 426 309 AstraZeneca PLC                                   | 47 883 027          | 7,04                    | 37 009 CMC Markets PLC  | 65 062              | 0,01                    |
| 55 970 Atrato Onsite Energy PLC                           | 47 882              | 0,01                    | 434 690 Coats Group PLC   | 320 367             | 0,05                    |
| 21 159 Auction Technology Group PLC                       | 129 916             | 0,02                    | 55 874 Coca-Cola HBC AG   | 1 236 492           | 0,18                    |
| 265 892 Auto Trader Group PLC                             | 1 638 426           | 0,24                    | 504 642 Compass Group PLC   | 10 259 372          | 1,51                    |
| 808 371 Aviva PLC   | 3 267 436           | 0,48                    | 26 570 Computacenter PLC  | 568 067             | 0,08                    |
| 8 704 Avon Protection PLC                                 | 80 643              | 0,01                    | 445 752 ConvaTec Group PLC  | 1 018 989           | 0,15                    |
| 256 466 B&M European Value Retail SA                      | 1 236 423           | 0,18                    | 33 367 Costain Group PLC  | 18 185              | 0,00                    |
| 147 302 Babcock International Group PLC                   | 440 138             | 0,06                    | 13 914 Cranswick PLC  | 417 977             | 0,06                    |
| 891 357 BAE Systems PLC                                   | 8 758 474           | 1,29                    | 57 728 Crest Nicholson Holdings PLC                               | 126 078             | 0,02                    |
| 26 000 Bakkavor Group PLC                                 | 27 092              | 0,00                    | 214 352 CRH PLC   | 8 748 777           | 1,29                    |
| 174 515 Balfour Beatty PLC                                | 649 894             | 0,10                    | 39 803 Croda International PLC                                    | 2 586 399           | 0,38                    |
| 71 858 Baltic Classifieds Group PLC                       | 111 380             | 0,02                    | 239 709 Currys PLC  | 140 829             | 0,02                    |
| 11 247 Bank of Georgia Group PLC                          | 309 292             | 0,05                    | 118 722 Darktrace PLC   | 305 947             | 0,04                    |
| 4 594 835 Barclays PLC                                    | 6 699 269           | 0,98                    | 28 392 DCC PLC  | 1 339 535           | 0,20                    |
| 279 187 Barratt Developments PLC                          | 1 302 407           | 0,19                    | 32 146 De La Rue PLC  | 16 619              | 0,00                    |
| 189 747 Beazley PLC                                       | 1 133 738           | 0,17                    | 31 476 Dechra Pharmaceuticals PLC                                 | 834 114             | 0,12                    |
| 33 059 Bellway PLC  | 729 612             | 0,11                    | 42 114 Devro PLC  | 138 134             | 0,02                    |
| 31 875 Berkeley Group Holdings PLC                        | 1 337 794           | 0,20                    | 51 439 DFS Furniture PLC  | 70 060              | 0,01                    |
| 122 268 BH Macro Ltd                                      | 512 303             | 0,08                    | 640 249 Diageo PLC  | 23 138 599          | 3,40                    |
| 21 962 Bloomsbury Publishing PLC                          | 97 951              | 0,01                    | 12 580 Dignity PLC  | 66 674              | 0,01                    |
| 49 939 Bodycote PLC                                       | 325 852             | 0,05                    | 38 523 Diploma PLC  | 1 082 496           | 0,16                    |
| 5 105 884 BP PLC  | 26 080 855          | 3,83                    | 378 609 Direct Line Insurance Group PLC                           | 520 587             | 0,08                    |

## SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur<br>GBP | % des<br>actifs<br>nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur<br>GBP | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,17 %) (suite)</b> |                     |                         | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,17 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Actions ordinaires – 91,05 % (mars 2022 : 89,01 %) (suite)</b> |                     |                         | <b>Actions ordinaires – 91,05 % (mars 2022 : 89,01 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Livre sterling – 91,05 % (suite)</b>                           |                     |                         | <b>Livre sterling – 91,05 % (suite)</b>                           |                     |                         |
| 29 509 DiscoverIE Group PLC                                       | 227 514             | 0,03                    | 65 975 Gym Group PLC  | 60 829              | 0,01                    |
| 214 247 Diversified Energy Co PLC                                 | 202 678             | 0,03                    | 1 419 989 Haleon PLC  | 4 572 365           | 0,67                    |
| 100 617 Domino's Pizza Group PLC                                  | 288 368             | 0,04                    | 70 948 Halfords Group PLC   | 124 017             | 0,02                    |
| 146 208 Dr Martens PLC  | 208 054             | 0,03                    | 106 941 Halma PLC   | 2 383 715           | 0,35                    |
| 108 611 Drax Group PLC  | 659 812             | 0,10                    | 208 504 Harbour Energy PLC  | 572 135             | 0,08                    |
| 365 259 DS Smith PLC  | 1 148 740           | 0,17                    | 109 294 Hargreaves Lansdown PLC                                   | 873 696             | 0,13                    |
| 30 577 Dunelm Group PLC   | 337 876             | 0,05                    | 39 807 Harworth Group PLC   | 43 191              | 0,01                    |
| 25 000 DWF Group PLC  | 16 750              | 0,00                    | 428 003 Hays PLC  | 477 223             | 0,07                    |
| 187 197 easyJet PLC   | 970 429             | 0,14                    | 29 045 Headlam Group PLC  | 88 297              | 0,01                    |
| 168 155 Elementis PLC   | 200 273             | 0,03                    | 235 949 Helios Towers PLC   | 246 331             | 0,04                    |
| 52 092 Endeavour Mining PLC                                       | 1 040 798           | 0,15                    | 22 393 Henry Boot PLC   | 49 936              | 0,01                    |
| 37 621 Energean PLC   | 489 825             | 0,07                    | 52 154 Hikma Pharmaceuticals PLC                                  | 873 579             | 0,13                    |
| 412 368 EnQuest PLC   | 76 371              | 0,01                    | 20 361 Hill & Smith PLC   | 273 245             | 0,04                    |
| 164 323 Entain PLC  | 2 064 718           | 0,30                    | 21 703 Hilton Food Group PLC                                      | 150 185             | 0,02                    |
| 109 563 Esken Ltd   | 5 818               | 0,00                    | 95 057 Hiscox Ltd   | 1 054 182           | 0,15                    |
| 94 678 Essentra PLC   | 183 107             | 0,03                    | 106 086 Hochschild Mining PLC                                     | 89 643              | 0,01                    |
| 154 000 Evraz PLC   | -                   | 0,00                    | 49 363 Hollywood Bowl Group PLC                                   | 115 016             | 0,02                    |
| 261 324 Experian PLC  | 6 951 218           | 1,02                    | 17 903 Hostelworld Group Plc                                      | 23 560              | 0,00                    |
| 27 919 FDM Group Holdings PLC                                     | 202 413             | 0,03                    | 150 999 Howden Joinery Group PLC                                  | 1 053 973           | 0,15                    |
| 82 014 Ferrexpo PLC   | 96 612              | 0,01                    | 5 795 607 HSBC Holdings PLC                                       | 31 858 452          | 4,68                    |
| 67 925 Finabl PLC   | -                   | 0,00                    | 72 466 Hunting PLC  | 171 020             | 0,03                    |
| 229 716 Firstgroup PLC  | 238 675             | 0,04                    | 45 607 Hyve Group PLC   | 51 353              | 0,01                    |
| 50 627 Flutter Entertainment PLC                                  | 7 406 730           | 1,09                    | 100 843 Istock PLC  | 173 954             | 0,03                    |
| 12 994 Foresight Group Holdings Ltd                               | 51 196              | 0,01                    | 113 842 IG Group Holdings PLC                                     | 795 186             | 0,12                    |
| 25 000 Foresight Sustainable Forestry Co Plc                      | 27 000              | 0,00                    | 71 726 IMI PLC  | 1 100 277           | 0,16                    |
| 52 846 Forterra PLC   | 104 952             | 0,02                    | 268 758 Imperial Brands PLC                                       | 5 009 649           | 0,74                    |
| 23 397 Foxtons Group PLC  | 9 417               | 0,00                    | 103 543 Inchcape PLC  | 801 941             | 0,12                    |
| 46 492 Frasers Group PLC  | 361 243             | 0,05                    | 33 724 Indivior PLC   | 467 077             | 0,07                    |
| 51 592 Fresnillo PLC  | 384 876             | 0,06                    | 405 700 Informa PLC   | 2 809 878           | 0,41                    |
| 15 638 Fuller Smith & Turner PLC                                  | 72 717              | 0,01                    | 73 593 IntegraFin Holdings PLC                                    | 200 173             | 0,03                    |
| 30 574 Funding Circle Holdings PLC                                | 16 388              | 0,00                    | 51 077 InterContinental Hotels Group PLC                          | 2 713 210           | 0,40                    |
| 33 360 Future PLC   | 386 642             | 0,06                    | 87 015 Intermediate Capital Group PLC                             | 1 058 973           | 0,16                    |
| 26 486 Galliford Try Holdings PLC                                 | 45 662              | 0,01                    | 1 044 792 International Consolidated Airlines Group SA            | 1 577 427           | 0,23                    |
| 9 103 Games Workshop Group PLC                                    | 877 529             | 0,13                    | 241 757 International Distributions Services PLC                  | 542 986             | 0,08                    |
| 61 320 Genuit Group PLC   | 171 083             | 0,03                    | 52 108 International Personal Finance PLC                         | 51 066              | 0,01                    |
| 18 890 Genus PLC  | 542 899             | 0,08                    | 45 474 Intertek Group PLC   | 1 843 061           | 0,27                    |
| 8 902 Georgia Capital PLC   | 69 881              | 0,01                    | 181 095 Investec PLC  | 814 203             | 0,12                    |
| 3 642 178 Glencore PLC  | 16 921 559          | 2,49                    | 275 259 IP Group PLC  | 152 356             | 0,02                    |
| 56 585 Grafton Group Plc Unit NPV                                 | 501 117             | 0,07                    | 1 109 353 ITV PLC   | 918 544             | 0,14                    |
| 208 754 Grainger PLC  | 486 397             | 0,07                    | 205 255 IWG PLC   | 337 542             | 0,05                    |
| 159 140 Greencore Group PLC                                       | 129 301             | 0,02                    | 26 655 J D Wetherspoon PLC  | 190 583             | 0,03                    |
| 30 782 Greggs PLC   | 853 893             | 0,13                    | 501 759 J Sainsbury PLC   | 1 398 402           | 0,21                    |
| 1 147 456 GSK PLC   | 16 397 146          | 2,41                    | 9 268 James Fisher & Sons PLC                                     | 26 877              | 0,00                    |

## SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur GBP | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur GBP | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,17 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,17 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 91,05 % (mars 2022 : 89,01 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 91,05 % (mars 2022 : 89,01 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Livre sterling – 91,05 % (suite)</b>                           |                  |                   | <b>Livre sterling – 91,05 % (suite)</b>                           |                  |                   |
| 672 784 JD Sports Fashion PLC                                     | 1 195 874        | 0,18              | 115 473 Nanoco Group PLC  | 27 367           | 0,00              |
| 176 650 John Wood Group PLC                                       | 353 300          | 0,05              | 139 334 National Express Group PLC                                | 169 569          | 0,02              |
| 50 209 Johnson Matthey PLC  | 995 896          | 0,15              | 1 047 468 National Grid PLC                                       | 11 485 487       | 1,69              |
| 164 023 JPMorgan European Growth & Income PLC                     | 154 182          | 0,02              | 1 560 759 NatWest Group PLC                                       | 4 114 161        | 0,60              |
| 37 084 JTC PLC  | 260 701          | 0,04              | 82 507 NCC Group PLC  | 84 322           | 0,01              |
| 138 911 Jupiter Fund Management PLC                               | 188 224          | 0,03              | 135 931 Network International Holdings PLC                        | 332 759          | 0,05              |
| 266 905 Just Group PLC  | 229 138          | 0,03              | 36 524 Next PLC   | 2 400 357        | 0,35              |
| 26 694 Kainos Group PLC   | 368 911          | 0,05              | 110 673 Ninety One PLC  | 204 966          | 0,03              |
| 24 337 Keller Group PLC   | 165 248          | 0,02              | 17 625 Norcross PLC   | 32 783           | 0,00              |
| 17 616 Kenmare Resources PLC                                      | 82 707           | 0,01              | 171 787 Ocado Group PLC   | 919 060          | 0,14              |
| 116 384 Kier Group PLC  | 79 374           | 0,01              | 183 142 Octopus Renewables Infrastructure Trust PLC               | 174 168          | 0,03              |
| 57 039 Kin & Carta PLC  | 44 091           | 0,01              | 43 450 On the Beach Group PLC                                     | 62 394           | 0,01              |
| 554 045 Kingfisher PLC  | 1 447 166        | 0,21              | 116 632 OSB Group PLC   | 561 700          | 0,08              |
| 66 121 Lancashire Holdings Ltd                                    | 365 319          | 0,05              | 27 988 Oxford Biomedica PLC                                       | 121 608          | 0,02              |
| 1 712 032 Legal & General Group PLC                               | 4 090 044        | 0,60              | 16 150 Oxford Instruments PLC                                     | 404 557          | 0,06              |
| 16 287 Liontrust Asset Management PLC                             | 166 453          | 0,02              | 112 179 Pagegroup PLC   | 511 985          | 0,08              |
| 19 306 286 Lloyds Banking Group PLC                               | 9 204 272        | 1,35              | 106 227 Pantheon Infrastructure PLC                               | 89 443           | 0,01              |
| 112 359 London Stock Exchange Group PLC                           | 8 840 406        | 1,30              | 69 800 Paragon Banking Group PLC                                  | 362 960          | 0,05              |
| 83 251 Lookers PLC  | 68 516           | 0,01              | 21 991 PayPoint PLC   | 100 059          | 0,01              |
| 17 562 LSL Property Services PLC                                  | 47 769           | 0,01              | 204 967 Pearson PLC   | 1 730 741        | 0,25              |
| 22 026 Luceco PLC   | 26 960           | 0,00              | 271 212 Pendragon PLC   | 44 886           | 0,01              |
| 648 786 M&G PLC   | 1 284 596        | 0,19              | 69 923 Pennon Group PLC   | 611 127          | 0,09              |
| 46 659 Macfarlane Group PLC                                       | 49 925           | 0,01              | 96 595 Persimmon PLC  | 1 213 233        | 0,18              |
| 343 971 Man Group PLC/Jersey                                      | 809 708          | 0,12              | 72 980 Petershill Partners PLC                                    | 123 482          | 0,02              |
| 561 844 Marks & Spencer Group PLC                                 | 938 279          | 0,14              | 37 037 Petra Diamonds Ltd   | 27 778           | 0,00              |
| 66 343 Marshalls PLC  | 207 786          | 0,03              | 116 489 Petrofac Ltd  | 91 735           | 0,01              |
| 240 119 Marston's PLC   | 86 107           | 0,01              | 161 053 Pets at Home Group PLC                                    | 594 286          | 0,09              |
| 56 390 ME GROUP INTERNATIONAL PLC                                 | 70 769           | 0,01              | 24 141 Pharos Energy PLC  | 5 408            | 0,00              |
| 18 649 Mears Group PLC  | 37 018           | 0,01              | 218 369 Phoenix Group Holdings PLC                                | 1 193 168        | 0,18              |
| 25 716 Medica Group PLC   | 40 117           | 0,01              | 15 000 Phoenix Spree Deutschland Ltd                              | 27 825           | 0,00              |
| 114 774 Mediclinic International PLC                              | 570 886          | 0,08              | 79 205 Playtech PLC   | 417 410          | 0,06              |
| 1 133 850 Melrose Industries PLC                                  | 1 887 860        | 0,28              | 26 578 Plus500 Ltd  | 449 700          | 0,07              |
| 104 712 Metro Bank PLC  | 111 204          | 0,02              | 9 420 Porvair PLC   | 56 520           | 0,01              |
| 80 295 Mitchells & Butlers PLC                                    | 132 085          | 0,02              | 4 637 PPHE Hotel Group Ltd  | 53 326           | 0,01              |
| 363 978 Mitie Group PLC   | 297 734          | 0,04              | 189 505 Premier Foods PLC   | 231 196          | 0,03              |
| 11 046 MJ Gleeson PLC   | 47 719           | 0,01              | 70 462 Provident Financial PLC                                    | 167 136          | 0,02              |
| 37 030 Molten Ventures PLC  | 101 314          | 0,01              | 790 005 Prudential PLC  | 8 705 855        | 1,28              |
| 141 729 Mondi PLC   | 1 816 966        | 0,27              | 75 924 PureTech Health PLC  | 168 172          | 0,02              |
| 141 252 Moneysupermarket.com Group PLC                            | 351 717          | 0,05              | 80 953 PZ Cussons PLC   | 149 925          | 0,02              |
| 88 362 Moonpig Group PLC  | 109 039          | 0,02              | 178 552 QinetiQ Group PLC   | 579 937          | 0,09              |
| 76 997 Morgan Advanced Materials PLC                              | 217 902          | 0,03              | 387 491 Quilter PLC   | 326 500          | 0,05              |
| 13 953 Morgan Sindall Group PLC                                   | 235 806          | 0,03              | 57 677 Rank Group PLC   | 42 162           | 0,01              |
| 20 080 Motorpoint group PLC                                       | 27 108           | 0,00              | 15 942 Rathbones Group PLC  | 305 130          | 0,04              |



## SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur<br>GBP | % des<br>actifs<br>nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur<br>GBP | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,17 %) (suite)</b> |                     |                         | <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,17 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Actions ordinaires – 91,05 % (mars 2022 : 89,01 %) (suite)</b> |                     |                         | <b>Actions ordinaires – 91,05 % (mars 2022 : 89,01 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Livre sterling – 91,05 % (suite)</b>                           |                     |                         | <b>Livre sterling – 91,05 % (suite)</b>                           |                     |                         |
| 80 059 Reach PLC  | 60 284              | 0,01                    | 151 892 St James's Place PLC                                      | 1 839 412           | 0,27                    |
| 206 188 Reckitt Benckiser Group PLC                               | 12 697 057          | 1,87                    | 681 189 Standard Chartered PLC                                    | 4 183 863           | 0,62                    |
| 25 000 Record PLC   | 19 600              | 0,00                    | 43 142 SThree PLC   | 179 686             | 0,03                    |
| 75 028 Redde Northgate PLC  | 259 222             | 0,04                    | 15 000 STV Group PLC  | 37 200              | 0,01                    |
| 88 398 Redrow PLC   | 420 951             | 0,06                    | 23 991 Superdry PLC   | 25 862              | 0,00                    |
| 554 452 RELX PLC  | 14 515 553          | 2,13                    | 92 767 Synthomer PLC  | 108 259             | 0,02                    |
| 33 613 Renewi PLC   | 204 031             | 0,03                    | 111 230 Tate & Lyle PLC   | 872 711             | 0,13                    |
| 9 031 Renishaw PLC  | 369 729             | 0,05                    | 70 639 Taylor Maritime Investments Ltd                            | 63 575              | 0,01                    |
| 714 206 Rentokil Initial PLC                                      | 4 225 243           | 0,62                    | 969 584 Taylor Wimpey PLC   | 1 153 320           | 0,17                    |
| 198 602 Restaurant Group PLC                                      | 80 871              | 0,01                    | 14 373 TBC Bank Group PLC   | 321 955             | 0,05                    |
| 6 961 RHI Magnesita NV  | 155 926             | 0,02                    | 18 152 Telecom Plus PLC   | 343 073             | 0,05                    |
| 23 886 Ricardo PLC  | 132 328             | 0,02                    | 2 111 263 Tesco PLC   | 5 609 626           | 0,82                    |
| 231 377 Rightmove PLC   | 1 302 653           | 0,19                    | 86 155 TI Fluid Systems PLC                                       | 92 530              | 0,01                    |
| 313 895 Rio Tinto PLC   | 17 195 168          | 2,53                    | 13 475 Topps Tiles PLC  | 6 145               | 0,00                    |
| 14 606 Robert Walters PLC   | 65 727              | 0,01                    | 212 031 TP ICAP Group PLC   | 381 868             | 0,06                    |
| 2 497 120 Rolls-Royce Holdings PLC                                | 3 721 208           | 0,55                    | 128 272 Trainline PLC   | 319 141             | 0,05                    |
| 248 920 Rotork PLC  | 783 600             | 0,12                    | 59 514 Travis Perkins PLC   | 569 192             | 0,08                    |
| 134 877 RS GROUP PLC  | 1 232 776           | 0,18                    | 19 817 Treatt PLC   | 115 335             | 0,02                    |
| 86 871 Sabre Insurance Group PLC                                  | 98 164              | 0,01                    | 40 145 Trifast PLC  | 31 233              | 0,00                    |
| 17 602 Saga PLC   | 23 463              | 0,00                    | 215 819 Tritax EuroBox PLC  | 130 571             | 0,02                    |
| 284 603 Sage Group PLC  | 2 205 673           | 0,32                    | 95 971 Trustpilot Group PLC                                       | 85 030              | 0,01                    |
| 36 628 Savills PLC  | 363 167             | 0,05                    | 70 151 TT Electronics PLC   | 131 323             | 0,02                    |
| 233 533 Schroders PLC   | 1 074 252           | 0,16                    | 33 151 TUI AG   | 206 730             | 0,03                    |
| 370 002 Sddl Energy Efficiency Income Trust PLC                   | 310 802             | 0,05                    | 375 736 Tullow Oil PLC  | 118 507             | 0,02                    |
| 4 313 Secure Trust Bank PLC                                       | 28 897              | 0,00                    | 46 727 Tyman PLC  | 112 378             | 0,02                    |
| 116 452 Senior PLC  | 182 830             | 0,03                    | 723 995 Unilever PLC  | 30 335 390          | 4,46                    |
| 342 849 Serco Group PLC   | 525 930             | 0,08                    | 207 090 United Utilities Group PLC                                | 2 195 154           | 0,32                    |
| 70 626 Severfield PLC   | 43 152              | 0,01                    | 58 801 Vesuvius PLC   | 243 319             | 0,04                    |
| 70 958 Severn Trent PLC   | 2 042 881           | 0,30                    | 113 092 VH Global Sustainable Energy Opportunities PLC            | 114 223             | 0,02                    |
| 2 009 211 Shell PLC   | 46 382 636          | 6,82                    | 30 604 Victrex PLC  | 487 522             | 0,07                    |
| 167 713 SIG PLC   | 72 787              | 0,01                    | 15 247 VIDENDUM PLC   | 134 936             | 0,02                    |
| 436 344 Sirius Real Estate Ltd                                    | 334 676             | 0,05                    | 361 369 Virgin Money UK PLC                                       | 527 418             | 0,08                    |
| 253 041 Smith & Nephew PLC  | 2 839 120           | 0,42                    | 103 846 Vistry Group PLC  | 811 037             | 0,12                    |
| 101 037 Smiths Group PLC  | 1 734 300           | 0,25                    | 6 807 319 Vodafone Group PLC                                      | 6 078 936           | 0,89                    |
| 76 007 Smurfit Kappa Group PLC                                    | 2 223 965           | 0,33                    | 49 253 Volution Group PLC   | 212 034             | 0,03                    |
| 33 438 Softcat PLC  | 433 356             | 0,06                    | 50 000 WAG Payment Solutions PLC                                  | 47 000              | 0,01                    |
| 29 173 Spectris PLC   | 1 067 440           | 0,16                    | 62 829 Watches of Switzerland Group PLC                           | 512 370             | 0,08                    |
| 79 659 Speedy Hire PLC  | 26 805              | 0,00                    | 73 839 Weir Group PLC   | 1 372 667           | 0,20                    |
| 20 785 Spirax-Sarco Engineering PLC                               | 2 464 062           | 0,36                    | 35 285 WH Smith PLC   | 527 511             | 0,08                    |
| 87 388 Spire Healthcare Group PLC                                 | 185 699             | 0,03                    | 57 017 Whitbread PLC  | 1 703 098           | 0,25                    |
| 170 623 Spirent Communications PLC                                | 295 690             | 0,04                    | 82 465 Wickes Group PLC   | 113 967             | 0,02                    |
| 312 534 SSE PLC   | 5 634 988           | 0,83                    | 33 476 Wincanton PLC  | 72 308              | 0,01                    |
| 232 042 SSP Group PLC   | 571 055             | 0,08                    | 24 516 Wizz Air Holdings Plc                                      | 728 861             | 0,11                    |

## SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur<br>GBP | % des<br>actifs<br>nets |
|--|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,17 %) (suite)</b>                  |                     |                         |
| <b>Actions ordinaires – 91,05 % (mars 2022 : 89,01 %) (suite)</b>                  |                     |                         |
| <b>Livre sterling – 91,05 % (suite)</b>  |                     |                         |
| 296 352 WPP PLC  | 2 840 830           | 0,42                    |
| 22 026 Xaar PLC  | 45 759              | 0,01                    |
| 5 076 XP Power Ltd   | 103 297             | 0,02                    |
| 59 052 XPS Pensions Group PLC  | 94 483              | 0,01                    |
| 9 559 Zotefoams PLC  | 37 089              | 0,01                    |
| <b>Total des actions ordinaires</b>  | <b>619 195 372</b>  | <b>91,05</b>            |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 2,07 % (mars 2022 : 2,67 %)</b> |                     |                         |
| <b>Livre sterling – 2,07 %</b>   |                     |                         |
| 100 716 ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LTD  | 54 286              | 0,01                    |
| 42 300 AEW UK REIT PLC   | 38 958              | 0,01                    |
| 808 484 Assura PLC   | 395 025             | 0,06                    |
| 144 573 Balanced Commercial Property Trust Ltd                                     | 119 128             | 0,02                    |
| 44 675 Big Yellow Group PLC  | 522 251             | 0,08                    |
| 288 811 British Land Co PLC  | 1 120 009           | 0,16                    |
| 462 784 Capital & Counties Properties PLC  | 530 813             | 0,08                    |
| 11 420 Capital & Regional PLC  | 6 852               | 0,00                    |
| 210 890 Civitas Social Housing PLC   | 113 248             | 0,02                    |
| 51 934 CLS Holdings PLC  | 69 799              | 0,01                    |
| 53 244 CT Property Trust Ltd   | 34 076              | 0,01                    |
| 187 651 Custodian Property Income Reit PLC   | 167 385             | 0,02                    |
| 33 211 Derwent London PLC  | 783 115             | 0,12                    |
| 64 599 Ediston Property Investment Co PLC  | 39 664              | 0,01                    |
| 187 296 Empiric Student Property PLC   | 169 128             | 0,02                    |
| 71 336 Great Portland Estates PLC  | 361 673             | 0,05                    |
| 1 131 308 Hammerson PLC  | 295 158             | 0,04                    |
| 25 409 Helical PLC   | 76 227              | 0,01                    |
| 202 546 Home Reit PLC  | 77 069              | 0,01                    |
| 151 601 Impact Healthcare Reit PLC   | 139 776             | 0,02                    |
| 88 932 Industrials REIT Ltd  | 104 940             | 0,02                    |
| 212 494 Land Securities Group PLC  | 1 320 013           | 0,19                    |
| 271 724 LondonMetric Property PLC  | 477 147             | 0,07                    |
| 412 787 LXI REIT PLC   | 406 182             | 0,06                    |
| 91 565 NewRiver REIT PLC   | 72 245              | 0,01                    |
| 6 675 Palace Capital PLC   | 14 418              | 0,00                    |
| 129 701 Picton Property Income Ltd   | 89 883              | 0,01                    |
| 350 657 Primary Health Properties PLC  | 354 865             | 0,05                    |
| 133 043 PRS REIT PLC   | 107 632             | 0,02                    |
| 94 573 Regional REIT Ltd   | 51 259              | 0,01                    |
| 53 594 Residential Secure Income PLC   | 33 979              | 0,01                    |
| 60 241 Safestore Holdings PLC  | 572 289             | 0,08                    |
| 136 914 Schroder Real Estate Investment Trust Ltd                                  | 59 626              | 0,01                    |
| 348 140 Segro PLC  | 2 672 323           | 0,39                    |

| Participation Investissement   | Juste valeur<br>GBP | % des<br>actifs<br>nets |
|--|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,17 %) (suite)</b>                          |                     |                         |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 2,07 % (mars 2022 : 2,67 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Livre sterling – 2,07 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 350 011 Supermarket Income Reit PLC  | 303 110             | 0,04                    |
| 154 862 Target Healthcare REIT PLC   | 108 558             | 0,02                    |
| 138 336 Triple Point Social Housing Reit PLC   | 59 069              | 0,01                    |
| 505 603 Tritax Big Box REIT PLC  | 707 339             | 0,10                    |
| 208 634 UK Commercial Property REIT Ltd  | 107 238             | 0,02                    |
| 91 937 UNITE Group PLC   | 882 135             | 0,13                    |
| 122 449 Urban Logistics REIT PLC   | 156 735             | 0,02                    |
| 129 634 Warehouse Reit PLC   | 132 486             | 0,02                    |
| 36 529 Workspace Group PLC   | 159 559             | 0,02                    |
| <b>Total des fiducies de placement immobilier de type REIT</b>                             | <b>14 066 670</b>   | <b>2,07</b>             |
| <b>Droits – 0,01 % (mars 2022 : néant)</b>   |                     |                         |
| <b>Livre sterling – 0,01 %</b>   |                     |                         |
| 88 402 TUI AG  | 94 590              | 0,01                    |
| <b>Total des droits</b>  | <b>94 590</b>       | <b>0,01</b>             |
| <b>Instruments en actions – 5,81 % (mars 2022 : 6,49 %)</b>                                |                     |                         |
| <b>Livre sterling – 5,81 %</b>   |                     |                         |
| 165 784 3i Infrastructure PLC  | 518 904             | 0,08                    |
| 23 286 Aberforth Smaller Companies Trust PLC   | 286 418             | 0,04                    |
| 35 738 Abrdn Asia Focus PLC  | 91 132              | 0,01                    |
| 43 386 Abrdn Asian Income Fund Ltd   | 91 978              | 0,01                    |
| 17 359 Abrdn China Investment Co   | 94 780              | 0,01                    |
| 112 139 Abrdn Diversified Income and Growth Trust PLC                                      | 91 281              | 0,01                    |
| 3 236 Abrdn Equity Income Trust PLC  | 10 727              | 0,00                    |
| 32 000 Abrdn New Dawn Investment Trust PLC   | 87 840              | 0,01                    |
| 15 484 Abrdn New India Investment Trust PLC  | 79 278              | 0,01                    |
| 24 258 Abrdn Private Equity Opportunities Trust PLC  | 99 943              | 0,02                    |
| 31 379 Abrdn UK Smaller Cos Growth Trust PLC   | 133 675             | 0,02                    |
| 82 056 Alliance Trust PLC  | 799 225             | 0,12                    |
| 125 318 Allianz Technology Trust PLC   | 288 858             | 0,04                    |
| 109 802 Apax Global Alpha Ltd  | 170 193             | 0,03                    |
| 2 507 Artemis Alpha Trust PLC  | 7 847               | 0,00                    |
| 42 403 Ashoka India Equity Investment Trust PLC  | 76 961              | 0,01                    |
| 33 827 Asia Dragon Trust PLC   | 135 985             | 0,02                    |
| 65 147 Augmentum Fintech PLC   | 63 193              | 0,01                    |
| 16 226 Aurora Investment Trust PLC   | 34 724              | 0,01                    |
| 151 615 Avi Global Trust PLC   | 283 217             | 0,04                    |
| 27 587 AVI Japan Opportunity Trust PLC   | 32 553              | 0,01                    |
| 19 937 Baillie Gifford China Growth Trust PLC  | 52 434              | 0,01                    |
| 67 958 Baillie Gifford European Growth Trust PLC   | 64 220              | 0,01                    |

## SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>GBP | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,17 %) (suite)</b>   |                     |                         |
| <b>Instruments en actions – 5,81 % (mars 2022 : 6,49 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Livre sterling – 5,81 % (suite)</b>                              |                     |                         |
| 23 130 Baillie Gifford Japan Trust PLC                              | 173 244             | 0,03                    |
| 74 185 Baillie Gifford Shin Nippon PLC                              | 113 503             | 0,02                    |
| 62 293 Baillie Gifford UK Growth Trust Plc                          | 103 033             | 0,02                    |
| 97 370 Baillie Gifford US Growth Trust PLC                          | 138 265             | 0,02                    |
| 347 951 Bankers Investment Trust PLC                                | 351 431             | 0,05                    |
| 226 092 BBGI Global Infrastructure SA                               | 341 399             | 0,05                    |
| 175 794 Bellevue Healthcare Trust Plc                               | 265 801             | 0,04                    |
| 11 634 Biotech Growth Trust PLC                                     | 91 094              | 0,01                    |
| 36 496 BlackRock Energy and Resources Income Trust PLC              | 47 445              | 0,01                    |
| 58 819 BlackRock Frontiers Investment Trust PLC                     | 79 112              | 0,01                    |
| 26 191 BlackRock Greater Europe Investment Trust PLC                | 139 336             | 0,02                    |
| 1 785 BlackRock Latin American Investment Trust PLC                 | 6 301               | 0,00                    |
| 17 256 BlackRock Smaller Cos Trust PLC                              | 223 638             | 0,03                    |
| 7 456 Blackrock Sustainable American Income Trust PLC               | 13 719              | 0,00                    |
| 26 188 Blackrock Throgmorton Trust PLC                              | 152 414             | 0,02                    |
| 49 115 BlackRock World Mining Trust PLC                             | 328 088             | 0,05                    |
| 189 746 Bluefield Solar Income Fund Ltd                             | 263 747             | 0,04                    |
| 1 520 Brown Advisory US Smaller Companies PLC                       | 18 088              | 0,00                    |
| 7 910 Brunner Investment Trust PLC                                  | 84 242              | 0,01                    |
| 8 798 Caledonia Investments PLC                                     | 298 252             | 0,04                    |
| 9 050 Capital Gearing Trust PLC                                     | 428 065             | 0,06                    |
| 20 000 CC Japan Income & Growth Trust PLC                           | 30 500              | 0,00                    |
| 132 558 City of London Investment Trust PLC                         | 548 790             | 0,08                    |
| 30 274 CQS Natural Resources Growth and Income PLC                  | 53 131              | 0,01                    |
| 220 130 CQS New City High Yield Fund Ltd                            | 108 634             | 0,02                    |
| 26 708 CT Private Equity Trust PLC                                  | 118 851             | 0,02                    |
| 27 474 CT UK Capital & Income Investment Trust PLC                  | 81 323              | 0,01                    |
| 288 941 Digital 9 Infrastructure PLC                                | 176 543             | 0,03                    |
| 67 903 Diverse Income Trust PLC                                     | 59 755              | 0,01                    |
| 50 278 Downing Renewables & Infrastructure Trust PLC                | 54 552              | 0,01                    |
| 37 376 Dunedin Income Growth Investment Trust PLC                   | 107 456             | 0,02                    |
| 27 396 Ecofin Global Utilities and Infrastructure Trust PLC         | 58 353              | 0,01                    |
| 50 830 Edinburgh Investment Trust PLC                               | 335 478             | 0,05                    |
| 123 793 Edinburgh Worldwide Investment Trust PLC                    | 192 127             | 0,03                    |
| 109 845 European Assets Trust PLC                                   | 101 716             | 0,02                    |

| Participation Investissement   | Juste valeur<br>GBP | % des<br>actifs<br>nets |
|--|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,17 %) (suite)</b>    |                     |                         |
| <b>Instruments en actions – 5,81 % (mars 2022 : 6,49 %) (suite)</b>  |                     |                         |
| <b>Livre sterling – 5,81 % (suite)</b>                               |                     |                         |
| 30 629 European Opportunities Trust PLC                              | 231 249             | 0,03                    |
| 102 261 European Smaller Companies                                   | 162 595             | 0,02                    |
| 156 921 F&C Investment Trust PLC                                     | 1 427 981           | 0,21                    |
| 18 155 Fidelity Asian Values PLC                                     | 91 864              | 0,01                    |
| 108 595 Fidelity China Special Situations PLC                        | 268 773             | 0,04                    |
| 23 295 Fidelity Emerging Markets Ltd                                 | 137 114             | 0,02                    |
| 123 258 Fidelity European Trust PLC                                  | 415 379             | 0,06                    |
| 40 061 Fidelity Japan Trust PLC                                      | 69 706              | 0,01                    |
| 70 006 Fidelity Special Values PLC                                   | 190 766             | 0,03                    |
| 59 619 Finsbury Growth & Income Trust PLC                            | 536 571             | 0,08                    |
| 179 804 Foresight Solar Fund Ltd                                     | 199 223             | 0,03                    |
| 151 338 GCP Asset Backed Income Fund Ltd                             | 104 423             | 0,02                    |
| 257 089 GCP Infrastructure Investments Ltd                           | 129 040             | 0,03                    |
| 132 715 Gore Street Energy Storage Fund PLC                          | 133 777             | 0,02                    |
| 656 811 Greencoat UK Wind PLC  | 1 029 880           | 0,15                    |
| 27 727 HarbourVest Global Private Equity Ltd                         | 568 403             | 0,08                    |
| 18 152 Henderson Diversified Income Trust PLC                        | 12 362              | 0,00                    |
| 65 154 Henderson European Focus Trust PLC                            | 103 595             | 0,02                    |
| 42 967 Henderson EuroTrust PLC                                       | 58 220              | 0,01                    |
| 39 932 Henderson Far East Income Ltd                                 | 103 923             | 0,02                    |
| 30 730 Henderson High Income Trust PLC                               | 52 548              | 0,01                    |
| 51 320 Henderson International Income Trust PLC                      | 89 938              | 0,01                    |
| 24 146 Henderson Smaller Companies Investment Trust PLC              | 196 066             | 0,03                    |
| 17 189 Herald Investment Trust PLC                                   | 301 495             | 0,04                    |
| 122 093 HgCapital Trust PLC  | 418 779             | 0,06                    |
| 565 206 Hicl Infrastructure PLC                                      | 876 069             | 0,13                    |
| 313 539 Hipgnosis Songs Fund Ltd                                     | 253 967             | 0,04                    |
| 20 478 ICG Enterprise Trust PLC                                      | 203 347             | 0,03                    |
| 80 438 Impax Environmental Markets PLC                               | 344 677             | 0,05                    |
| 11 823 International Biotechnology Trust PLC                         | 78 386              | 0,01                    |
| 546 329 International Public Partnerships Ltd                        | 791 084             | 0,12                    |
| 20 906 INVESCO Asia Trust PLC  | 71 603              | 0,01                    |
| 44 503 Invesco Bond Income Plus Ltd                                  | 72 095              | 0,01                    |
| 3 823 Invesco Select Trust PLC                                       | 5 849               | 0,00                    |
| 161 928 JLEN Environmental Assets Group Ltd Foresight Group Holdings | 193 666             | 0,03                    |
| 54 914 JPMorgan American Investment Trust PLC                        | 389 889             | 0,06                    |
| 20 393 JPMorgan Asia Growth & Income PLC                             | 75 658              | 0,01                    |
| 27 371 JPMorgan China Growth & Income                                | 88 819              | 0,01                    |
| 15 247 JPMorgan Claverhouse Investment Trust PLC                     | 103 375             | 0,02                    |

## SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>GBP | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,17 %) (suite)</b>   |                     |                         |
| <b>Instruments en actions – 5,81 % (mars 2022 : 6,49 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Livre sterling – 5,81 % (suite)</b>                              |                     |                         |
| 316 483 JPMorgan Emerging Markets Investment Trust PLC              | 344 333             | 0,05                    |
| 40 783 JPMorgan European Discovery Trust PLC                        | 172 512             | 0,03                    |
| 48 212 JPMorgan Global Core Real Assets Ltd                         | 41 462              | 0,01                    |
| 70 077 JPMorgan Global Emerging Markets Income Trust PLC            | 90 925              | 0,01                    |
| 107 335 JPMorgan Global Growth & Income PLC                         | 489 984             | 0,07                    |
| 22 232 JPMorgan Indian Investment Trust PLC                         | 173 410             | 0,03                    |
| 16 660 JPMorgan Japan Small Cap Growth & Income PLC                 | 54 062              | 0,01                    |
| 37 052 JPMorgan Japanese Investment Trust PLC                       | 173 403             | 0,03                    |
| 3 031 JPMorgan Mid Cap Investment Trust PLC                         | 26 794              | 0,00                    |
| 11 451 JPMorgan UK Smaller Companies Investment Trust PLC           | 29 544              | 0,00                    |
| 11 386 JPMorgan US Smaller Cos Investment Trust PLC                 | 44 519              | 0,01                    |
| 6 894 Keystone Positive Change Investment Trust PLC                 | 14 546              | 0,00                    |
| 40 443 Law Debenture Corp PLC                                       | 324 353             | 0,05                    |
| 36 Lindsell Train Investment Trust PLC                              | 37 890              | 0,01                    |
| 76 445 Lowland Investment Company PLC                               | 94 983              | 0,01                    |
| 31 224 M&G Credit Income Investment Trust PLC                       | 28 414              | 0,00                    |
| 1 781 Majedie Investments PLC                                       | 3 740               | 0,00                    |
| 28 004 Martin Currie Global Portfolio Trust PLC                     | 95 774              | 0,01                    |
| 248 010 Mercantile Investment Trust PLC                             | 497 260             | 0,07                    |
| 40 586 Merchants Trust PLC  | 232 152             | 0,03                    |
| 13 912 Mid Wynd International Investment Trust PLC                  | 95 367              | 0,01                    |
| 11 083 Middlefield Canadian Income PC                               | 11 970              | 0,00                    |
| 39 241 Mobius Investment Trust PLC                                  | 52 092              | 0,01                    |
| 64 436 Monks Investment Trust PLC                                   | 625 029             | 0,09                    |
| 74 609 Montanaro European Smaller Cos Trust PLC                     | 102 662             | 0,02                    |
| 17 521 Montanaro UK Smaller Companies Investment Trust PLC          | 18 397              | 0,00                    |
| 31 098 Murray Income Trust PLC                                      | 265 266             | 0,04                    |
| 32 442 Murray International Trust PLC                               | 434 074             | 0,06                    |
| 52 986 NB Global Monthly Income Fund Ltd                            | 38 415              | 0,01                    |
| 14 147 NB Private Equity Partners Ltd                               | 198 765             | 0,03                    |
| 151 351 NextEnergy Solar Fund Ltd                                   | 158 616             | 0,02                    |
| 39 035 North American Income Trust PLC                              | 109 688             | 0,02                    |
| 2 189 North Atlantic Smaller Cos Investment Trust PLC               | 73 988              | 0,01                    |
| 36 658 Odyssean Investment Trust PLC                                | 60 119              | 0,01                    |
| 32 491 Pacific Assets Trust PLC                                     | 115 018             | 0,02                    |

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>GBP | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,17 %) (suite)</b>   |                     |                         |
| <b>Instruments en actions – 5,81 % (mars 2022 : 6,49 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Livre sterling – 5,81 % (suite)</b>                              |                     |                         |
| 22 132 Pacific Horizon Investment Trust PLC                         | 126 374             | 0,02                    |
| 154 134 Pantheon International PLC                                  | 359 903             | 0,05                    |
| 44 368 Pershing Square Holdings Ltd                                 | 1 253 396           | 0,18                    |
| 126 224 Personal Assets Trust PLC                                   | 602 720             | 0,09                    |
| 85 136 Polar Capital Global Financials Trust PLC                    | 116 466             | 0,02                    |
| 33 513 Polar Capital Global Healthcare Trust PLC                    | 106 236             | 0,02                    |
| 37 755 Polar Capital Technology Trust PLC                           | 755 100             | 0,11                    |
| 9 520 Pollen Street PLC   | 53 312              | 0,01                    |
| 51 592 Real Estate Credit Investments Ltd                           | 68 875              | 0,01                    |
| 719 036 Renewables Infrastructure Group Ltd                         | 897 357             | 0,13                    |
| 36 592 RIT Capital Partners PLC                                     | 702 566             | 0,10                    |
| 5 947 Riverstone Energy Ltd   | 33 898              | 0,01                    |
| 95 854 Ruffer Investment Co Ltd                                     | 295 230             | 0,04                    |
| 37 818 Schroder Asian Total Return Investment Co PLC                | 161 010             | 0,02                    |
| 57 109 Schroder AsiaPacific Fund PLC                                | 295 254             | 0,04                    |
| 4 203 Schroder Income Growth Fund PLC                               | 12 462              | 0,00                    |
| 28 160 Schroder Japan Growth Fund PLC                               | 57 728              | 0,01                    |
| 61 430 Schroder Oriental Income Fund Ltd                            | 158 797             | 0,02                    |
| 20 523 Schroder UK Mid Cap Fund PLC                                 | 114 108             | 0,02                    |
| 399 753 Schroder UK Public Private                                  | 50 449              | 0,01                    |
| 53 286 Scottish American Investment Co PLC                          | 271 226             | 0,04                    |
| 420 957 Scottish Mortgage Investment Trust PLC                      | 2 856 614           | 0,42                    |
| 7 259 Scottish Oriental Smaller Companies Trust PLC                 | 86 019              | 0,01                    |
| 37 387 Securities Trust of Scotland PLC                             | 80 008              | 0,01                    |
| 503 103 Sequoia Economic Infrastructure Income Fund Ltd             | 404 495             | 0,06                    |
| 49 877 Smithson Investment Trust PLC                                | 684 811             | 0,10                    |
| 84 497 Starwood European Real Estate Finance Ltd                    | 75 963              | 0,01                    |
| 11 018 Strategic Equity Capital PLC                                 | 32 613              | 0,01                    |
| 146 218 Syncona Limited   | 216 695             | 0,03                    |
| 98 867 Temple Bar Investment Trust PLC                              | 228 383             | 0,03                    |
| 327 920 Templeton Emerging Markets Investment Trust PLC             | 499 094             | 0,07                    |
| 161 668 The Global Smaller Companies Trust PLC                      | 229 892             | 0,03                    |
| 89 185 TR Property Investment Trust PLC - Ordinary Shares           | 248 826             | 0,04                    |
| 110 613 Troy Income & Growth Trust PLC                              | 78 093              | 0,01                    |
| 269 270 TwentyFour Income Fund Ltd                                  | 270 616             | 0,04                    |
| 95 193 TwentyFour Select Monthly Income Fund Ltd                    | 69 396              | 0,01                    |
| 55 159 Utilico Emerging Markets Trust PLC                           | 119 695             | 0,02                    |

## SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation   | Investissement                              | Juste valeur<br>GBP | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,94 % (mars 2022 : 98,17 %) (suite)</b>   |   |                     |                         |
| <b>Instruments en actions – 5,81 % (mars 2022 : 6,49 %) (suite)</b> |   |                     |                         |
| <b>Livre sterling – 5,81 % (suite)</b>                              |   |                     |                         |
| 2 555   | Value and Indexed Property Income Trust Plc | 5 225               | 0,00                    |
| 48 215  | Vietnam Enterprise Investments Ltd          | 277 236             | 0,04                    |
| 49 129  | VinaCapital Vietnam Opportunity Fund Ltd    | 212 237             | 0,03                    |
| 83 877  | VPC Specialty Lending Investments PLC       | 63 747              | 0,01                    |
| 208 134   | Witan Investment Trust PLC                  | 462 057             | 0,07                    |
| 17 932  | Worldwide Healthcare Trust PLC              | 558 582             | 0,08                    |
| <b>Total des instruments en actions</b>                             |   | <b>39 537 236</b>   | <b>5,81</b>             |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>                                 |   | <b>672 893 868</b>  | <b>98,94</b>            |

Instruments financiers dérivés – 0,01 % (mars 2022 : 0,09 %)

Contrats à terme standardisés – 0,01 % (mars 2022 : 0,09 %)

| Montant<br>notionnel   | Prix<br>du coût<br>moyen | Plus-values<br>latentes<br>GBP   | % des<br>actifs<br>nets |
|--|--------------------------|--|-------------------------|
| 6 414 418  | 7 546                    | 85 of FTSE 100 Index<br>Futures Long Futures<br>Contracts Expiring<br>16 June 2023 | 0,01                    |
| <b>Plus-values latentes nettes sur<br/>contrats à terme standardisés</b> |                          | <b>78 731</b>  | <b>0,01</b>             |
| <b>Total des instruments financiers<br/>dérivés</b>                      |                          | <b>78 731</b>  | <b>0,01</b>             |

|   | Juste valeur<br>GBP | % du<br>Comp. |
|---|---------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | <b>672 972 599</b>  | <b>98,95</b>  |
| <b>Disponibilités bancaires*</b><br>(mars 2022 : 1,08 %)                                | <b>12 588 155</b>   | <b>1,85</b>   |
| <b>Liquidités détenues auprès d'un<br/>courtier* (mars 2022 : 0,02 %)</b>               | <b>302 304</b>      | <b>0,04</b>   |
| <b>Découverts bancaires</b><br>(mars 2022 : néant)                                      | <b>(11 277)</b>     | <b>(0,00)</b> |
| <b>Autres passifs nets</b><br>(mars 2022 : 0,64 %)                                      | <b>(5 753 226)</b>  | <b>(0,84)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs<br/>d'actions de participation rachetables</b> | <b>680 098 555</b>  | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company, à l'exception des liquidités détenues auprès d'un courtier, en l'occurrence Goldman Sachs.

Le courtier pour les contrats à terme standardisés ouverts est Goldman Sachs.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                        |  | % du<br>total<br>des actifs |
|---|--|-----------------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs |  | 97,49                       |
| Instruments financiers dérivés négociés en Bourse                       |  | 0,01                        |
| Autres actifs   |  | 2,50                        |
| <b>Total des actifs</b>   |  | <b>100,00</b>               |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |            |
|--|-------|----------------------|----------------------|------------|
| <b>Actifs circulants</b>   |       |                      |                      |            |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                         | 1(e)  |                      |                      |            |
| Valeurs mobilières   |       | 2 621 855 590        | 3 177 620 183        |            |
| Instruments financiers dérivés   |       | 5 898 551            | 2 827 978            |            |
|  |       | <b>2 627 754 141</b> | <b>3 180 448 161</b> |            |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie  | 1(f)  | 4 599 695            | 7 993 643            |            |
| Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties à des instruments financiers ouverts | 1(g)  | 217 366              | 150 456              |            |
| Créances :   |       |                      |                      |            |
| Dividendes à recevoir  |       | 5 611 295            | 6 255 907            |            |
| <b>Total des actifs circulants</b>   |       | <b>2 638 182 497</b> | <b>3 194 848 167</b> |            |
| <b>Passifs circulants</b>  |       |                      |                      |            |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                        | 1(e)  |                      |                      |            |
| Instruments financiers dérivés   |       | (439 606)            | (3 239 995)          |            |
| Liquidités dues aux courtiers et aux contreparties pour des instruments financiers ouverts       | 1(g)  | -                    | (242 886)            |            |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :   |       |                      |                      |            |
| Charges à payer  |       | (887 254)            | (1 082 265)          |            |
| À payer sur achats d'investissements   |       | (824)                | -                    |            |
| <b>Total des passifs circulants</b>  |       | <b>(1 327 684)</b>   | <b>(4 565 146)</b>   |            |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>              |       | <b>2 636 854 813</b> | <b>3 190 283 021</b> |            |
|  |       | <b>2023</b>          | <b>2022</b>          |            |
|  |       | <b>2021</b>          |                      |            |
| Valeur liquidative par action  |       |                      |                      |            |
| Catégorie couverte en EUR  | 5     | 15,25 USD            | 16,54 USD            | 15,24 USD  |
| Catégorie couverte en USD  | 5     | 18,05 USD            | 19,07 USD            | 17,53 USD  |
| Catégorie non couverte en USD  | 5     | 176,10 USD           | 190,27 USD           | 177,29 USD |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD        |
|--|-------|----------------------|--------------------|
| Produits de dividendes   |       | 61 896 624           | 62 124 429         |
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur   |       | 8 633                | 393                |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat                 | 9     | (322 755 978)        | 138 355 010        |
| Produits divers  |       | 130 577              | 18 609             |
| <b>Total des (charges)/revenus d'investissement</b>  |       | <b>(260 720 144)</b> | <b>200 498 441</b> |
| Charges opérationnelles  | 3     | (10 742 916)         | (13 159 685)       |
| <b>(Perte)/Bénéfice net(te) pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(271 463 060)</b> | <b>187 338 756</b> |
| <b>Charges financières</b>   |       |                      |                    |
| Charges d'intérêts   |       | -                    | (14 913)           |
| <b>(Perte)/Bénéfice pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(271 463 060)</b> | <b>187 323 843</b> |
| Impôt sur les plus-values de capital   | 2     | 128 913              | (206 408)          |
| Retenue à la source sur produits d'investissement  | 2     | (7 741 026)          | (7 475 182)        |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(279 075 173)</b> | <b>179 642 253</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|--|----------------------|----------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier                              | 3 190 283 021        | 2 846 437 201        |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(279 075 173)</b> | <b>179 642 253</b>   |
| <b>Opérations sur actions</b>  |                      |                      |
| Produits sur actions de participation rachetables émises   | 874 134 108          | 1 068 118 866        |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables   | (1 148 487 143)      | (903 915 299)        |
| (Diminution)/Augmentation des actifs nets résultant d'opérations sur actions   | (274 353 035)        | 164 203 567          |
| <b>(Diminution)/Augmentation totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                   | <b>(553 428 208)</b> | <b>343 845 820</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>                       | <b>2 636 854 813</b> | <b>3 190 283 021</b> |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.



## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|--|-------|----------------------|----------------------|
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(279 075 173)</b> | <b>179 642 253</b>   |
| <b>Ajustement pour :</b>   |       |                      |                      |
| Variation de la trésorerie détenue par/à payer au courtier   |       | (309 796)            | 937 051              |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat   |       | 555 765 417          | (353 147 872)        |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés  |       | (5 870 962)          | (3 648 362)          |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>  |       | <b>270 509 486</b>   | <b>(176 216 930)</b> |
| Variation des montants à recevoir  |       | 644 612              | (1 094 910)          |
| Variation des montants à payer   |       | (195 011)            | 129 902              |
| <b>Entrées/(Sorties) de trésorerie sur opérations</b>  |       | <b>449 601</b>       | <b>(965 008)</b>     |
| <b>Entrées/(Sorties) de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>   |       | <b>270 959 087</b>   | <b>(177 181 938)</b> |
| <b>Activités de financement</b>  |       |                      |                      |
| Produits des souscriptions   | 5     | 874 134 108          | 1 068 118 866        |
| Paiements sur rachats  | 5     | (1 148 487 143)      | (903 915 299)        |
| <b>Trésorerie nette (utilisée)/générée sur activités de financement</b>  |       | <b>(274 353 035)</b> | <b>164 203 567</b>   |
| <b>Diminution nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>  |       | <b>(3 393 948)</b>   | <b>(12 978 371)</b>  |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier   |       | 7 993 643            | 20 972 014           |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>  |       | <b>4 599 695</b>     | <b>7 993 643</b>     |
| <b>Informations supplémentaires</b>  |       |                      |                      |
| Impôts payés   |       | (7 612 113)          | (7 681 590)          |
| Intérêts reçus   |       | 8 633                | 394                  |
| Intérêts payés   |       | -                    | (14 913)             |
| Dividendes reçus   |       | 62 541 236           | 61 029 519           |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                              | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar australien – 1,80 %</b>                         |                  |                   |
| 9 019 Ampol Ltd   | 184 174          | 0,01              |
| 47 544 APA Group CVS NPV                                  | 322 247          | 0,01              |
| 33 832 Aristocrat Leisure Ltd                             | 842 914          | 0,03              |
| 11 898 ASX  | 518 124          | 0,02              |
| 48 342 Aurizon Holdings Ltd                               | 108 787          | 0,00              |
| 138 828 Australia & New Zealand Banking Group             | 2 132 033        | 0,08              |
| 242 606 BHP Group Ltd                                     | 7 674 186        | 0,29              |
| 20 877 BlueScope Steel Ltd                                | 281 745          | 0,01              |
| 106 639 Brambles Ltd                                      | 959 191          | 0,04              |
| 2 009 Cochlear  | 318 473          | 0,01              |
| 60 705 Coles Group Ltd                                    | 732 643          | 0,03              |
| 74 277 Commonwealth Bank of Australia                     | 4 891 129        | 0,19              |
| 12 212 Computershare Ltd                                  | 176 584          | 0,01              |
| 20 072 CSL Ltd  | 3 875 682        | 0,15              |
| 93 629 Endeavour Group Ltd/Australia                      | 424 534          | 0,02              |
| 76 106 Fortescue Metals Group Ltd                         | 1 146 361        | 0,04              |
| 168 543 Insurance Australia Group Ltd                     | 529 415          | 0,02              |
| 22 510 LendLease Group CVS NPV                            | 109 000          | 0,00              |
| 81 253 Lottery Corp Ltd                                   | 278 626          | 0,01              |
| 16 562 Macquarie Group Ltd                                | 1 948 492        | 0,07              |
| 73 471 Medibank Pvt Ltd                                   | 165 336          | 0,01              |
| 8 148 Mineral Resources Ltd                               | 439 790          | 0,02              |
| 141 143 National Australia Bank                           | 2 620 387        | 0,10              |
| 47 631 Newcrest Mining Ltd                                | 856 538          | 0,03              |
| 18 495 Northern Star Resources Ltd                        | 152 484          | 0,01              |
| 23 554 Orica Ltd  | 242 782          | 0,01              |
| 62 914 Origin Energy Ltd                                  | 349 313          | 0,01              |
| 110 801 QBE Insurance Group                               | 1 082 709        | 0,04              |
| 9 077 Ramsay Health Care Ltd                              | 404 518          | 0,01              |
| 1 205 REA Group Ltd                                       | 111 397          | 0,00              |
| 15 625 Rio Tinto Ltd                                      | 1 257 247        | 0,05              |
| 92 727 Santos Ltd   | 428 517          | 0,02              |
| 10 860 SEEK Ltd   | 173 982          | 0,01              |
| 19 223 Sonic Healthcare Ltd                               | 448 551          | 0,02              |
| 282 022 South32 Ltd                                       | 825 424          | 0,03              |
| 95 140 Suncorp Group                                      | 771 650          | 0,03              |
| 192 095 Telstra Group Ltd                                 | 542 927          | 0,02              |
| 136 186 Transurban Group CVS NPV                          | 1 296 103        | 0,05              |
| 26 619 Treasury Wine Estates Ltd                          | 233 013          | 0,01              |
| 3 295 Washington H Soul Pattinson & Co Ltd                | 66 646           | 0,00              |
| 46 715 Wesfarmers   | 1 572 191        | 0,06              |
| 148 419 Westpac Banking Corp                              | 2 153 083        | 0,08              |
| 3 962 WiseTech Global Ltd                                 | 172 852          | 0,01              |
| 81 537 Woodside Energy Group Ltd                          | 1 820 678        | 0,07              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Dollar australien – 1,80 % (suite)</b>                         |                   |                   |
| 57 552 Woolworths Group Ltd                                       | 1 460 873         | 0,05              |
| 6 416 Xero Ltd  | 384 248           | 0,01              |
|   | <b>47 487 579</b> | <b>1,80</b>       |
| <b>Réal brésilien – 0,41 %</b>                                    |                   |                   |
| 310 455 Ambev SA  | 877 436           | 0,03              |
| 9 900 Atacadao SA   | 24 192            | 0,00              |
| 300 179 B3 SA - Brasil Bolsa Balcao                               | 612 761           | 0,02              |
| 38 625 Banco Bradesco SA  | 90 273            | 0,00              |
| 20 848 Banco BTG Pactual SA Unit NPV                              | 80 797            | 0,00              |
| 30 827 Banco do Brasil SA   | 237 788           | 0,01              |
| 15 900 Banco Santander Brasil Unit NPV                            | 84 043            | 0,00              |
| 25 900 BB Seguridade Participacoes SA                             | 166 069           | 0,01              |
| 63 615 CCR SA   | 160 598           | 0,01              |
| 55 588 Centrais Eletricas Brasileiras SA (Voting rights)          | 364 867           | 0,01              |
| 16 800 Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo            | 167 694           | 0,01              |
| 54 394 Cia Siderurgica Nacional SA                                | 165 641           | 0,01              |
| 80 636 Cosan SA   | 239 988           | 0,01              |
| 13 800 Energisa Unit NPV  | 109 360           | 0,00              |
| 54 822 Equatorial Energia SA                                      | 291 505           | 0,01              |
| 266 195 Hapvida Participacoes e Investimentos S/A                 | 137 554           | 0,01              |
| 6 500 Hypera SA   | 48 331            | 0,00              |
| 34 300 JBS SA   | 120 754           | 0,01              |
| 28 941 Klabin Unit NPV  | 103 258           | 0,00              |
| 20 464 Localiza Rent a Car SA                                     | 215 527           | 0,01              |
| 30 829 Lojas Renner SA  | 100 752           | 0,00              |
| 294 202 Magazine Luiza SA   | 192 063           | 0,01              |
| 71 812 Natura & Co Holding SA                                     | 186 957           | 0,01              |
| 69 800 Petro Rio SA   | 429 380           | 0,02              |
| 186 365 Petroleo Brasileiro SA                                    | 973 682           | 0,04              |
| 34 895 Raia Drogasil SA   | 168 272           | 0,01              |
| 14 700 Rede D'Or Sao Luiz SA                                      | 61 580            | 0,00              |
| 56 858 Rumo SA  | 211 385           | 0,01              |
| 16 700 Sendas Distribuidora SA                                    | 51 184            | 0,00              |
| 24 744 Suzano SA  | 203 018           | 0,01              |
| 12 000 Telefonica Brasil SA                                       | 91 498            | 0,00              |
| 62 000 TIM SA/Brazil  | 153 831           | 0,01              |
| 61 700 TOTVS SA   | 342 680           | 0,01              |
| 115 010 Ultrapar Participacoes SA                                 | 316 659           | 0,01              |
| 153 786 Vale SA   | 2 435 280         | 0,09              |
| 17 900 Vibra Energia SA   | 50 873            | 0,00              |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Réal brésilien – 0,41 % (suite)</b>                            |                   |                   |
| 62 600 WEG SA   | 500 652           | 0,02              |
|   | <b>10 768 182</b> | <b>0,41</b>       |
| <b>Dollar canadien – 3,00 %</b>                                   |                   |                   |
| 26 182 Agnico Eagle Mines   | 1 332 944         | 0,05              |
| 2 100 Air Canada  | 29 715            | 0,00              |
| 38 324 Algonquin Power & Utilities Corp                           | 321 125           | 0,01              |
| 39 357 Alimentation Couche-Tard Inc                               | 1 976 065         | 0,08              |
| 6 356 AltaGas Ltd   | 105 812           | 0,00              |
| 12 900 ARC Resources Ltd  | 146 124           | 0,01              |
| 26 890 Bank of Montreal   | 2 391 856         | 0,09              |
| 51 916 Bank of Nova Scotia  | 2 611 240         | 0,10              |
| 72 164 Barrick Gold Corp  | 1 337 861         | 0,05              |
| 5 700 BCE   | 254 981           | 0,01              |
| 13 533 Brookfield Asset Management Ltd                            | 442 684           | 0,02              |
| 54 652 Brookfield Corp  | 1 778 053         | 0,07              |
| 700 Brookfield Renewable Corp                                     | 24 445            | 0,00              |
| 8 600 CAE Inc   | 194 197           | 0,01              |
| 19 800 Cameco   | 517 768           | 0,02              |
| 39 083 Canadian Imperial Bank of Commerce                         | 1 655 039         | 0,06              |
| 28 746 Canadian National Railway Co                               | 3 387 242         | 0,13              |
| 55 716 Canadian Natural Resources Ltd                             | 3 079 026         | 0,12              |
| 44 467 Canadian Pacific Railway Ltd                               | 3 419 426         | 0,13              |
| 2 529 Canadian Tire Corp Ltd                                      | 329 582           | 0,01              |
| 1 900 Canadian Utilities Ltd                                      | 52 872            | 0,00              |
| 4 593 CCL Industries Inc  | 227 860           | 0,01              |
| 55 557 Cenovus Energy Inc   | 967 994           | 0,04              |
| 12 106 CGI Inc  | 1 165 114         | 0,04              |
| 941 Constellation Software Inc/Canada                             | 1 766 724         | 0,07              |
| 11 907 Dollarama Inc  | 710 628           | 0,03              |
| 18 269 Emera Inc  | 749 470           | 0,03              |
| 5 700 Empire Co Ltd   | 152 592           | 0,01              |
| 90 224 Enbridge Inc   | 3 435 359         | 0,13              |
| 943 Fairfax Financial Holdings Ltd                                | 626 295           | 0,02              |
| 25 630 First Quantum Minerals Ltd                                 | 588 410           | 0,02              |
| 20 709 Fortis Inc/Canada  | 879 102           | 0,03              |
| 9 574 Franco-Nevada Corp  | 1 394 556         | 0,05              |
| 3 480 George Weston Ltd   | 460 537           | 0,02              |
| 6 300 Gildan Activewear Inc                                       | 209 015           | 0,01              |
| 12 196 Great-West Lifeco Inc                                      | 322 799           | 0,01              |
| 14 943 Hydro One Ltd  | 424 876           | 0,02              |
| 3 600 iA Financial Corp Inc                                       | 227 861           | 0,01              |
| 1 800 IGM Financial Inc   | 53 720            | 0,00              |
| 10 317 Imperial Oil Ltd   | 523 950           | 0,02              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Dollar canadien – 3,00 % (suite)</b>                           |                   |                   |
| 8 919 Intact Financial Corp                                       | 1 274 698         | 0,05              |
| 8 268 Keyera Corp   | 180 774           | 0,01              |
| 48 893 Kinross Gold Corp  | 229 770           | 0,01              |
| 9 618 Loblaw Cos Ltd  | 875 346           | 0,03              |
| 15 400 Lundin Mining Corp   | 104 461           | 0,00              |
| 15 931 Magna International Inc                                    | 852 141           | 0,03              |
| 86 027 Manulife Financial Corp                                    | 1 576 436         | 0,06              |
| 12 932 Metro Inc/CN   | 710 359           | 0,03              |
| 20 103 National Bank of Canada                                    | 1 435 960         | 0,05              |
| 11 189 Northland Power Inc  | 280 107           | 0,01              |
| 28 228 Nutrien Ltd  | 2 081 824         | 0,08              |
| 2 900 Nuvei Corp  | 126 170           | 0,00              |
| 3 300 Onex Corp   | 154 058           | 0,01              |
| 13 395 Open Text Corp   | 515 965           | 0,02              |
| 6 100 Pan American Silver   | 111 151           | 0,00              |
| 4 500 Parkland Corp   | 107 733           | 0,00              |
| 32 686 Pembina Pipeline Corp                                      | 1 057 371         | 0,04              |
| 41 916 Power Corp of Canada                                       | 1 069 774         | 0,04              |
| 2 900 Quebecor Inc  | 71 592            | 0,00              |
| 9 657 Restaurant Brands International Inc                         | 647 415           | 0,02              |
| 2 700 Ritchie Bros Auctioneers Inc                                | 151 704           | 0,01              |
| 16 702 Rogers Communications                                      | 773 054           | 0,03              |
| 60 183 Royal Bank of Canada                                       | 5 747 702         | 0,22              |
| 6 900 Saputo Inc  | 178 293           | 0,01              |
| 36 366 Shaw Communications  | 1 086 667         | 0,04              |
| 48 122 Shopify Inc  | 2 304 138         | 0,09              |
| 29 322 Sun Life Financial   | 1 368 006         | 0,05              |
| 70 849 Suncor Energy Inc  | 2 196 641         | 0,08              |
| 41 686 TC Energy Corp   | 1 619 266         | 0,06              |
| 18 577 Teck Resources Ltd   | 677 412           | 0,03              |
| 16 340 TELUS Corp   | 323 938           | 0,01              |
| 2 349 TELUS Corp (Non Canadian)                                   | 46 569            | 0,00              |
| 4 000 TFI International Inc                                       | 476 654           | 0,02              |
| 9 148 Thomson Reuters Corp  | 1 188 594         | 0,05              |
| 4 000 Torontom Industries Ltd                                     | 327 868           | 0,01              |
| 77 999 Toronto-Dominion Bank                                      | 4 665 474         | 0,18              |
| 8 100 Tourmaline Oil Corp   | 337 084           | 0,01              |
| 4 500 West Fraser Timber Co Ltd                                   | 320 538           | 0,01              |
| 21 884 Wheaton Precious Metals Corp                               | 1 052 521         | 0,04              |
| 4 331 WSP Global Inc  | 566 533           | 0,02              |
|   | <b>79 146 680</b> | <b>3,00</b>       |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Peso chilien – 0,02 %</b>                                      |                   |                   |
| 891 201 Banco de Chile  | 87 022            | 0,00              |
| 890 Banco de Crédito e Inversiones                                | 26 230            | 0,00              |
| 1 442 749 Banco Santander Chile                                   | 64 326            | 0,00              |
| 16 702 Cencosud SA  | 32 449            | 0,00              |
| 2 669 Cia Cervecerías Unidas SA                                   | 20 660            | 0,00              |
| 1 001 964 Cia Sud Americana de Vapores SA                         | 100 170           | 0,01              |
| 29 776 Empresas CMPC SA   | 50 030            | 0,00              |
| 14 968 Empresas Copec SA  | 106 210           | 0,01              |
| 656 124 Enel Americas SA  | 86 890            | 0,00              |
| 720 315 Enel Chile SA   | 39 505            | 0,00              |
| 10 417 Falabella SA   | 24 086            | 0,00              |
|   | <b>637 578</b>    | <b>0,02</b>       |
| <b>Peso colombien – 0,00 %</b>                                    |                   |                   |
| 4 605 Bancolombia SA  | 34 582            | 0,00              |
| 24 266 Interconexion Electrica SA ESP                             | 78 902            | 0,00              |
|   | <b>113 484</b>    | <b>0,00</b>       |
| <b>Couronne tchèque – 0,03 %</b>                                  |                   |                   |
| 10 039 CEZ AS   | 488 271           | 0,02              |
| 6 312 Komerčni Banka AS   | 209 583           | 0,01              |
| 15 673 Moneta Money Bank AS                                       | 63 101            | 0,00              |
|   | <b>760 955</b>    | <b>0,03</b>       |
| <b>Couronne danoise – 0,81 %</b>                                  |                   |                   |
| 49 AP Moller - Maersk A/S (Class A)                               | 86 901            | 0,00              |
| 343 AP Moller - Maersk A/S (Class B)                              | 622 563           | 0,02              |
| 7 423 Carlsberg AS  | 1 150 819         | 0,04              |
| 4 335 Chr Hansen Holding A/S                                      | 329 398           | 0,01              |
| 6 365 Coloplast A/S   | 837 149           | 0,03              |
| 36 356 Danske Bank A/S  | 731 728           | 0,03              |
| 2 836 Demant A/S  | 99 351            | 0,01              |
| 9 876 DSV A/S   | 1 910 657         | 0,07              |
| 3 024 Genmab A/S  | 1 141 848         | 0,04              |
| 69 343 Novo Nordisk A/S   | 10 981 125        | 0,42              |
| 10 277 Novozymes A/S  | 525 950           | 0,02              |
| 8 314 Orsted AS   | 707 409           | 0,03              |
| 4 569 Pandora A/S   | 436 739           | 0,02              |
| 17 260 Tryg A/S   | 377 343           | 0,02              |
| 48 139 Vestas Wind Systems A/S                                    | 1 397 155         | 0,05              |
|   | <b>21 336 135</b> | <b>0,81</b>       |
| <b>Livre égyptienne – 0,01 %</b>                                  |                   |                   |
| 91 726 Commercial International Bank Egypt SAE                    | 151 914           | 0,01              |
| 110 250 Eastern Co SAE  | 62 642            | 0,00              |
|   | <b>214 556</b>    | <b>0,01</b>       |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 8,39 %</b>  |                  |                   |
| 4 751 Accor SA  | 154 697          | 0,01              |
| 12 111 ACS Actividades de Construcción y Servicios SA             | 386 187          | 0,01              |
| 7 920 adidas AG   | 1 400 670        | 0,05              |
| 876 Adyen NV  | 1 388 765        | 0,05              |
| 77 437 Aegon NV   | 332 403          | 0,01              |
| 3 361 Aena SME SA   | 543 717          | 0,02              |
| 1 004 Aeroports de Paris  | 143 603          | 0,01              |
| 4 215 Ageas SA/NV   | 182 534          | 0,01              |
| 17 856 AIB Group PLC  | 72 593           | 0,00              |
| 22 130 Air Liquide SA   | 3 707 452        | 0,14              |
| 25 376 Airbus   | 3 398 799        | 0,13              |
| 9 571 Akzo Nobel NV   | 748 478          | 0,03              |
| 16 246 Allianz SE   | 3 756 019        | 0,14              |
| 71 457 Alpha Services and Holdings SA                             | 87 339           | 0,00              |
| 10 888 Alstom SA  | 296 678          | 0,01              |
| 18 988 Amadeus IT Group SA  | 1 272 016        | 0,05              |
| 12 268 Amplifon SpA   | 425 714          | 0,02              |
| 1 279 Amundi SA   | 80 664           | 0,00              |
| 34 405 Anheuser-Busch InBev SA/NV                                 | 2 292 473        | 0,09              |
| 24 831 ArcelorMittal SA   | 751 867          | 0,03              |
| 2 204 Argenx SE (Belgium listing)                                 | 815 818          | 0,03              |
| 2 533 Arkema SA   | 249 880          | 0,01              |
| 24 906 Aroundtown SA  | 35 529           | 0,00              |
| 2 097 ASM International NV  | 847 294          | 0,03              |
| 18 031 ASML Holding NV  | 12 247 529       | 0,46              |
| 56 036 Assicurazioni Generali SpA                                 | 1 118 980        | 0,04              |
| 83 165 AXA SA   | 2 544 837        | 0,10              |
| 310 175 Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA                        | 2 214 359        | 0,08              |
| 766 389 Banco Santander SA  | 2 852 636        | 0,11              |
| 37 140 Bank of Ireland Group PLC                                  | 376 230          | 0,01              |
| 37 447 BASF SE  | 1 967 492        | 0,07              |
| 40 470 Bayer AG   | 2 581 838        | 0,10              |
| 14 013 Bayerische Motoren Werke AG (Voting rights)                | 1 536 753        | 0,06              |
| 458 Bechtle AG  | 21 889           | 0,00              |
| 4 796 Beiersdorf AG   | 625 013          | 0,02              |
| 1 367 BioMerieux  | 144 062          | 0,01              |
| 50 176 BNP Paribas SA   | 3 009 702        | 0,11              |
| 21 379 Bolloré SE   | 132 163          | 0,00              |
| 7 693 Bouygues SA   | 259 852          | 0,01              |
| 10 080 Brenntag SE  | 757 838          | 0,03              |
| 7 838 Bureau Veritas SA   | 225 408          | 0,01              |
| 139 557 CaixaBank SA  | 543 412          | 0,02              |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 8,39 % (suite)</b>                                      |                  |                   |
| 7 399 Capgemini SE  | 1 372 598        | 0,05              |
| 853 Carl Zeiss Meditec AG   | 118 623          | 0,00              |
| 34 151 Carrefour SA   | 691 235          | 0,03              |
| 19 921 Cellnex Telecom SA   | 773 960          | 0,03              |
| 22 432 Cie de Saint-Gobain  | 1 275 103        | 0,05              |
| 28 204 Cie Generale des Etablissements Michelin SCA               | 862 426          | 0,03              |
| 33 642 CNH Industrial NV  | 514 629          | 0,02              |
| 35 642 Commerzbank AG   | 375 693          | 0,01              |
| 6 318 Continental AG  | 473 080          | 0,02              |
| 9 711 Covestro AG   | 402 291          | 0,01              |
| 56 545 Credit Agricole SA   | 638 784          | 0,02              |
| 28 828 CRH PLC  | 1 455 605        | 0,05              |
| 23 225 Daimler Truck Holding AG                                   | 784 992          | 0,03              |
| 25 169 Danone SA  | 1 567 134        | 0,06              |
| 780 Dassault Aviation SA  | 154 741          | 0,01              |
| 29 312 Dassault Systemes SE                                       | 1 206 168        | 0,05              |
| 15 288 Davide Campari-Milano NV                                   | 186 859          | 0,01              |
| 11 151 Delivery Hero SE   | 380 048          | 0,01              |
| 91 531 Deutsche Bank AG   | 930 397          | 0,03              |
| 8 490 Deutsche Boerse AG  | 1 655 240        | 0,06              |
| 46 366 Deutsche Lufthansa AG                                      | 516 841          | 0,02              |
| 38 309 Deutsche Post AG   | 1 793 441        | 0,07              |
| 136 550 Deutsche Telekom AG                                       | 3 315 728        | 0,13              |
| 755 DiaSorin SpA  | 79 615           | 0,00              |
| 95 135 E.ON SE  | 1 188 633        | 0,04              |
| 14 156 Edenred  | 838 813          | 0,03              |
| 50 641 EDP - Energias de Portugal                                 | 275 975          | 0,01              |
| 13 814 EDP Renovaveis SA  | 316 523          | 0,01              |
| 2 411 Eiffage SA  | 261 262          | 0,01              |
| 2 659 Elia Group SA/NV  | 351 287          | 0,01              |
| 5 389 Elisa Oyj   | 325 297          | 0,01              |
| 8 066 Enagas SA   | 155 110          | 0,01              |
| 8 544 Endesa SA   | 185 653          | 0,01              |
| 340 350 Enel SpA  | 2 080 714        | 0,08              |
| 79 520 Engie SA   | 1 259 113        | 0,05              |
| 123 912 Eni SpA   | 1 737 460        | 0,07              |
| 6 440 Erste Group Bank AG   | 213 400          | 0,01              |
| 12 954 EssilorLuxottica SA  | 2 336 263        | 0,09              |
| 1 268 Eurazeo SE  | 90 234           | 0,00              |
| 76 456 Eurobank Ergasias Services and Holdings SA                 | 101 091          | 0,00              |
| 5 500 Eurofins Scientific SE                                      | 368 328          | 0,01              |
| 4 108 Euronext NV   | 315 008          | 0,01              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 8,39 % (suite)</b>                                      |                  |                   |
| 6 908 Evonik Industries AG  | 145 301          | 0,01              |
| 3 728 EXOR NV   | 307 174          | 0,01              |
| 5 110 Ferrari NV  | 1 384 054        | 0,05              |
| 26 623 Ferrovial SA   | 783 566          | 0,03              |
| 3 386 FF Group  | -                | 0,00              |
| 17 274 FinecoBank Banca Fineco SpA                                | 265 370          | 0,01              |
| 6 274 Flutter Entertainment PLC                                   | 1 142 767        | 0,04              |
| 15 510 Fortum Oyj   | 237 850          | 0,01              |
| 11 711 Fresenius Medical Care AG & Co KGaA                        | 497 486          | 0,02              |
| 23 049 Fresenius SE & Co KGaA                                     | 622 283          | 0,02              |
| 19 491 Galp Energia SGPS SA                                       | 221 501          | 0,01              |
| 4 605 GEA Group AG  | 209 880          | 0,01              |
| 807 Getlink SE  | 13 318           | 0,00              |
| 14 489 Grifols SA   | 143 374          | 0,01              |
| 8 275 Groupe Bruxelles Lambert NV                                 | 705 744          | 0,03              |
| 2 481 Hannover Rueck SE   | 486 130          | 0,02              |
| 6 617 HeidelbergCement AG   | 483 535          | 0,02              |
| 5 817 Heineken Holding NV   | 534 346          | 0,02              |
| 11 660 Heineken NV  | 1 254 893        | 0,05              |
| 3 793 Hellenic Telecommunications Organization SA                 | 55 591           | 0,00              |
| 6 856 HelloFresh SE   | 163 201          | 0,01              |
| 3 823 Henkel AG & Co KGaA (Voting rights)                         | 278 284          | 0,01              |
| 1 335 Hermes International  | 2 703 565        | 0,10              |
| 296 576 Iberdrola SA  | 3 700 639        | 0,14              |
| 2 797 IMCD NV   | 457 036          | 0,02              |
| 45 495 Industria de Diseno Textil SA                              | 1 527 326        | 0,06              |
| 56 865 Infineon Technologies                                      | 2 327 907        | 0,09              |
| 7 774 Infrastrutture Wireless Italiane SpA                        | 102 366          | 0,00              |
| 177 239 ING Groep NV  | 2 104 695        | 0,08              |
| 690 469 Intesa Sanpaolo SpA                                       | 1 776 004        | 0,07              |
| 1 392 Ipsen SA  | 153 502          | 0,01              |
| 9 835 Jeronimo Martins SGPS SA                                    | 231 015          | 0,01              |
| 6 844 JUMBO SA  | 144 995          | 0,01              |
| 4 946 Just Eat Takeaway.com NV                                    | 94 199           | 0,00              |
| 14 400 KBC Group NV   | 990 321          | 0,04              |
| 3 246 Kering SA   | 2 115 970        | 0,08              |
| 8 406 Kerry Group PLC   | 838 747          | 0,03              |
| 13 093 Kesko Oyj  | 281 724          | 0,01              |
| 6 621 Kingspan Group  | 453 471          | 0,02              |
| 1 685 Knorr-Bremse AG   | 112 183          | 0,00              |
| 13 956 Kone Oyj   | 727 800          | 0,03              |
| 50 557 Koninklijke Ahold Delhaize NV                              | 1 729 672        | 0,07              |
| 8 402 Koninklijke DSM NV  | 992 252          | 0,04              |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 8,39 % (suite)</b>                                      |                  |                   | <b>Euro – 8,39 % (suite)</b>                                      |                  |                   |
| 165 994 Koninklijke KPN NV  | 587 201          | 0,02              | 13 994 Safran SA  | 2 075 924        | 0,08              |
| 41 105 Koninklijke Philips NV                                     | 751 871          | 0,03              | 20 935 Sampo Oyj  | 988 945          | 0,04              |
| 3 982 La Francaise des Jeux SAEM                                  | 166 084          | 0,01              | 48 247 Sanofi   | 5 254 375        | 0,20              |
| 4 145 LEG Immobilien SE   | 227 328          | 0,01              | 43 069 SAP SE   | 5 430 716        | 0,21              |
| 13 156 Legrand SA   | 1 201 784        | 0,05              | 979 Sartorius Stedim Biotech                                      | 299 945          | 0,01              |
| 10 560 L'Oreal SA   | 4 718 235        | 0,18              | 23 613 Schneider Electric SE (France listing)                     | 3 942 559        | 0,15              |
| 11 702 LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE                        | 10 735 395       | 0,41              | 3 455 Scout24 SE  | 205 327          | 0,01              |
| 21 093 Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA                | 212 390          | 0,01              | 774 SEB SA  | 88 128           | 0,00              |
| 33 038 Mercedes-Benz Group AG                                     | 2 540 587        | 0,10              | 33 416 Siemens AG   | 5 418 856        | 0,21              |
| 7 676 Merck KGaA  | 1 430 657        | 0,05              | 20 841 Siemens Energy AG  | 458 288          | 0,02              |
| 7 104 Moncler SpA   | 490 411          | 0,02              | 8 884 Siemens Healthineers AG                                     | 511 750          | 0,02              |
| 3 177 MTU Aero Engines AG   | 795 951          | 0,03              | 6 623 Smurfit Kappa Group PLC                                     | 239 828          | 0,01              |
| 6 451 Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen   | 2 260 302        | 0,09              | 103 847 Snam SpA  | 551 599          | 0,02              |
| 15 645 National Bank of Greece SA                                 | 75 979           | 0,00              | 42 150 Societe Generale SA  | 951 825          | 0,04              |
| 9 107 Naturgy Energy Group SA                                     | 274 567          | 0,01              | 3 096 Sodexo SA   | 302 930          | 0,01              |
| 1 367 Nemetschek SE   | 93 982           | 0,00              | 2 417 Solvay SA   | 276 644          | 0,01              |
| 20 928 Neste Oyj  | 1 032 952        | 0,04              | 99 174 Stellantis NV  | 1 803 264        | 0,07              |
| 15 477 Nexi SpA   | 125 877          | 0,00              | 30 067 STMicroelectronics NV                                      | 1 599 178        | 0,06              |
| 17 153 NN Group NV  | 623 556          | 0,02              | 31 190 Stora Enso Oyj   | 405 959          | 0,02              |
| 270 914 Nokia Oyj   | 1 329 067        | 0,05              | 7 324 Symrise AG  | 797 307          | 0,03              |
| 5 354 OMV AG  | 245 820          | 0,01              | 416 088 Telecom Italia SpA/Milano                                 | 137 516          | 0,00              |
| 13 932 OPAP SA  | 223 868          | 0,01              | 14 547 Telefonica Deutschland Holding AG                          | 44 838           | 0,00              |
| 109 693 Orange SA   | 1 305 215        | 0,05              | 311 616 Telefonica SA   | 1 345 080        | 0,05              |
| 4 257 Orion Oyj   | 190 504          | 0,01              | 3 419 Teleperformance   | 823 521          | 0,03              |
| 9 608 Pernod Ricard SA  | 2 178 538        | 0,08              | 14 352 Tenaris SA   | 204 265          | 0,01              |
| 17 455 Poste Italiane SpA   | 178 489          | 0,01              | 99 025 Tema - Rete Elettrica Nazionale                            | 813 993          | 0,03              |
| 37 418 Prosus NV  | 2 924 561        | 0,11              | 5 200 Thales SA   | 770 315          | 0,03              |
| 8 550 Prysmian SpA  | 359 490          | 0,01              | 105 232 TotalEnergies SE  | 6 214 941        | 0,24              |
| 3 891 Public Power Corp SA  | 33 734           | 0,00              | 8 038 UCB SA  | 719 939          | 0,03              |
| 6 235 Publicis Groupe SA  | 486 239          | 0,02              | 10 137 Unicore SA   | 343 726          | 0,01              |
| 2 920 Puma SE   | 180 385          | 0,01              | 95 493 UniCredit SpA  | 1 806 259        | 0,07              |
| 9 289 QIAGEN NV   | 422 957          | 0,02              | 4 707 United Internet AG  | 81 158           | 0,00              |
| 3 732 Randstad NV   | 221 383          | 0,01              | 51 753 Universal Music Group NV                                   | 1 310 371        | 0,05              |
| 44 Rational AG  | 29 495           | 0,00              | 24 687 UPM-Kymmene Oyj  | 830 116          | 0,03              |
| 2 802 Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA              | 118 603          | 0,00              | 7 653 Valeo   | 157 229          | 0,01              |
| 12 645 Red Electrica Corp SA                                      | 222 558          | 0,01              | 42 606 Veolia Environnement SA                                    | 1 314 616        | 0,05              |
| 570 Remy Cointreau  | 104 038          | 0,00              | 1 741 Verbund AG  | 151 321          | 0,01              |
| 6 068 Renault SA  | 247 881          | 0,01              | 22 649 Vinci SA   | 2 601 452        | 0,10              |
| 59 100 Repsol SA  | 910 807          | 0,03              | 30 816 Vivendi SE   | 311 364          | 0,01              |
| 1 534 Rheinmetall AG  | 455 986          | 0,02              | 5 641 voestalpine AG  | 191 705          | 0,01              |
| 26 510 RWE AG   | 1 141 703        | 0,04              | 1 087 Volkswagen AG (Voting rights)                               | 186 593          | 0,01              |
|   |                  |                   | 32 934 Vonovia SE   | 620 445          | 0,02              |
|   |                  |                   | 16 847 Wartsila OYJ Abp   | 159 020          | 0,01              |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|---|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Euro – 8,39 % (suite)</b>                                      |                    |                   |
| 832 Wendel SE   | 87 997             | 0,00              |
| 12 980 Wolters Kluwer NV  | 1 640 782          | 0,06              |
| 13 264 Worldline SA/France  | 563 601            | 0,02              |
| 7 550 Zalando SE  | 316 132            | 0,01              |
|   | <b>221 165 686</b> | <b>8,39</b>       |
| <b>Dollar de Hong Kong – 3,37 %</b>                               |                    |                   |
| 55 500 3SBio Inc  | 55 288             | 0,00              |
| 24 500 AAC Technologies Holdings Inc                              | 60 423             | 0,00              |
| 1 472 000 Agricultural Bank of China Ltd                          | 545 675            | 0,02              |
| 511 400 AIA Group Ltd   | 5 384 392          | 0,20              |
| 38 000 Air China Ltd  | 33 982             | 0,00              |
| 655 232 Alibaba Group Holding Ltd                                 | 8 380 345          | 0,32              |
| 358 000 Alibaba Health Information Technology Ltd                 | 259 039            | 0,01              |
| 86 000 Aluminum Corp of China Ltd                                 | 43 603             | 0,00              |
| 44 000 Anhui Conch Cement Co Ltd                                  | 152 460            | 0,01              |
| 2 100 Anhui Gujing Distillery Co Ltd                              | 37 479             | 0,00              |
| 85 400 ANTA Sports Products Ltd                                   | 1 240 212          | 0,05              |
| 76 000 AviChina Industry & Technology Co Ltd                      | 39 888             | 0,00              |
| 132 056 Baidu Inc   | 2 501 510          | 0,10              |
| 2 654 000 Bank of China Ltd                                       | 1 017 655          | 0,04              |
| 311 000 Bank of Communications Co Ltd                             | 195 713            | 0,01              |
| 37 700 BeiGene Ltd  | 621 454            | 0,02              |
| 58 000 Beijing Capital International Airport Co Ltd               | 42 706             | 0,00              |
| 15 000 Beijing Enterprises Holdings Ltd                           | 53 981             | 0,00              |
| 154 000 Beijing Enterprises Water Group Ltd                       | 38 451             | 0,00              |
| 11 460 Bilibili Inc   | 276 794            | 0,01              |
| 8 000 BOC Aviation Ltd  | 61 809             | 0,00              |
| 161 500 BOC Hong Kong Holdings Ltd                                | 503 019            | 0,02              |
| 40 500 Budweiser Brewing Co APAC Ltd                              | 123 565            | 0,01              |
| 30 000 BYD Co Ltd (Class H)                                       | 878 222            | 0,03              |
| 34 000 BYD Electronic International Co Ltd                        | 105 682            | 0,00              |
| 377 000 CGN Power Co Ltd  | 90 289             | 0,00              |
| 510 000 China Cinda Asset Management Co Ltd                       | 64 319             | 0,00              |
| 554 000 China CITIC Bank Corp Ltd                                 | 278 766            | 0,01              |
| 206 000 China Coal Energy Co Ltd                                  | 156 141            | 0,01              |
| 300 000 China Com Rich Rene Ene Invest                            | -                  | 0,00              |
| 78 000 China Communications Services Corp Ltd                     | 38 354             | 0,00              |
| 127 500 China Conch Venture Holdings Ltd                          | 222 517            | 0,01              |
| 3 787 000 China Construction Bank Corp                            | 2 455 535          | 0,09              |
| 63 000 China Everbright Bank Co Ltd                               | 19 101             | 0,00              |
| 109 629 China Everbright Environment Group Ltd                    | 47 064             | 0,00              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar de Hong Kong – 3,37 % (suite)</b>                       |                  |                   |
| 116 400 China Evergrande Group                                    | 6 117            | 0,00              |
| 276 000 China Feihe Ltd   | 207 089          | 0,01              |
| 101 000 China Galaxy Securities Co Ltd                            | 50 822           | 0,00              |
| 138 400 China Gas Holdings Ltd                                    | 194 995          | 0,01              |
| 28 400 China International Capital Corp Ltd                       | 56 945           | 0,00              |
| 190 585 China Jinmao Holdings Group Ltd                           | 37 146           | 0,00              |
| 277 000 China Life Insurance Co Ltd                               | 455 200          | 0,02              |
| 40 400 China Literature Ltd                                       | 208 434          | 0,01              |
| 122 000 China Longyuan Power Group Corp Ltd                       | 139 407          | 0,01              |
| 46 000 China Medical System Holdings Ltd                          | 72 663           | 0,00              |
| 26 000 China Meidong Auto Holdings Ltd                            | 56 107           | 0,00              |
| 274 000 China Mengniu Dairy Co Ltd                                | 1 123 931        | 0,04              |
| 223 914 China Merchants Bank Co Ltd                               | 1 143 823        | 0,04              |
| 25 219 China Merchants Port Holdings Co Ltd                       | 38 680           | 0,00              |
| 251 600 China Minsheng Banking Corp Ltd                           | 86 218           | 0,00              |
| 130 000 China National Building Material Co Ltd                   | 106 650          | 0,00              |
| 70 000 China Oilfield Services Ltd                                | 71 784           | 0,00              |
| 274 831 China Overseas Land & Investment                          | 663 800          | 0,03              |
| 115 600 China Pacific Insurance Group Co Ltd                      | 307 041          | 0,01              |
| 1 629 800 China Petroleum & Chemical Corp                         | 963 353          | 0,04              |
| 405 000 China Power International Development Ltd                 | 160 969          | 0,01              |
| 62 000 China Railway Group Ltd (Class H)                          | 37 832           | 0,00              |
| 68 000 China Resources Beer Holdings Co Ltd                       | 545 736          | 0,02              |
| 42 000 China Resources Cement Holdings Ltd                        | 20 599           | 0,00              |
| 28 000 China Resources Gas Group Ltd                              | 103 262          | 0,00              |
| 272 000 China Resources Land Ltd                                  | 1 240 467        | 0,05              |
| 41 800 China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd                | 219 651          | 0,01              |
| 124 089 China Resources Power Holdings Co Ltd                     | 264 303          | 0,01              |
| 192 000 China Ruyi Holdings Ltd                                   | 50 140           | 0,00              |
| 203 500 China Shenhua Energy Co Ltd                               | 640 316          | 0,02              |
| 68 000 China Southern Airlines Co Ltd                             | 48 510           | 0,00              |
| 46 000 China State Construction International Holdings Ltd        | 52 036           | 0,00              |
| 42 800 China Taiping Insurance Holdings Co Ltd                    | 45 472           | 0,00              |
| 2 180 000 China Tower Corp Ltd                                    | 263 823          | 0,01              |
| 56 000 China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd         | 29 320           | 0,00              |
| 53 300 China Vanke Co Ltd   | 84 058           | 0,00              |
| 178 000 Chinasoft International Ltd                               | 112 696          | 0,00              |
| 222 000 CITIC Ltd   | 259 614          | 0,01              |
| 83 950 CITIC Securities Co Ltd                                    | 179 237          | 0,01              |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar de Hong Kong – 3,37 % (suite)</b>                       |                  |                   |
| 108 430 CK Asset Holdings Ltd                                     | 658 181          | 0,03              |
| 109 228 CK Hutchison Holdings Ltd                                 | 677 635          | 0,03              |
| 26 000 CK Infrastructure Holdings Ltd                             | 141 428          | 0,01              |
| 88 500 CLP Holdings Ltd   | 639 233          | 0,02              |
| 72 000 CMOG Group Ltd   | 43 567           | 0,00              |
| 155 350 COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd                            | 174 745          | 0,01              |
| 319 999 Country Garden Holdings Co Ltd                            | 90 089           | 0,00              |
| 99 784 Country Garden Services Holdings Co Ltd                    | 172 621          | 0,01              |
| 582 800 CSPC Pharmaceutical Group                                 | 573 152          | 0,02              |
| 65 500 Dali Foods Group Co Ltd                                    | 27 368           | 0,00              |
| 46 000 Dongfeng Motor Group Co Ltd                                | 21 564           | 0,00              |
| 97 000 Dongyue Group Ltd  | 100 090          | 0,00              |
| 53 500 ENN Energy Holdings Ltd                                    | 733 330          | 0,03              |
| 95 000 ESR Group Ltd  | 170 396          | 0,01              |
| 101 000 Far East Horizon Ltd                                      | 90 836           | 0,00              |
| 18 000 Flat Glass Group Co Ltd                                    | 51 593           | 0,00              |
| 215 000 Fosun International Ltd                                   | 157 759          | 0,01              |
| 28 000 Fuyao Glass Industry Group Co Ltd                          | 121 988          | 0,01              |
| 137 000 Galaxy Entertainment Group Ltd                            | 915 375          | 0,04              |
| 24 080 Ganfeng Lithium Group Co Ltd                               | 149 696          | 0,01              |
| 50 300 GDS Holdings Ltd   | 121 746          | 0,01              |
| 375 000 Geely Automobile Holdings Ltd                             | 482 487          | 0,02              |
| 72 000 Genscript Biotech Corp                                     | 154 090          | 0,01              |
| 28 696 GF Securities Co Ltd                                       | 40 650           | 0,00              |
| 99 500 Great Wall Motor Co Ltd                                    | 122 823          | 0,01              |
| 88 000 Guangdong Investment Ltd                                   | 90 018           | 0,00              |
| 78 400 Guangzhou Automobile Group Co Ltd                          | 49 437           | 0,00              |
| 44 000 Haidilao International Holding Ltd                         | 119 109          | 0,01              |
| 72 000 Haier Smart Home Co Ltd                                    | 226 549          | 0,01              |
| 36 000 Haitian International Holdings Ltd                         | 93 096           | 0,00              |
| 103 200 Haitong Securities Co Ltd                                 | 64 418           | 0,00              |
| 87 000 Hang Lung Properties Ltd                                   | 162 697          | 0,01              |
| 43 200 Hang Seng Bank Ltd   | 614 710          | 0,02              |
| 60 000 Hansoh Pharmaceutical Group Co Ltd                         | 104 255          | 0,00              |
| 58 280 Henderson Land Development Co Ltd                          | 201 568          | 0,01              |
| 63 000 Hengan International Group Co Ltd                          | 291 327          | 0,01              |
| 157 000 HKT Trust & HKT Com HDK 0.0005                            | 208 401          | 0,01              |
| 659 146 Hong Kong & China Gas Co Ltd                              | 580 220          | 0,02              |
| 52 127 Hong Kong Exchanges & Clearing                             | 2 312 196        | 0,09              |
| 422 000 Huaneng Power International Inc                           | 221 484          | 0,01              |
| 24 400 Huatai Securities Co Ltd                                   | 27 881           | 0,00              |
| 281 900 Huishan Dairy   | -                | 0,00              |
| 26 200 Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd                          | 186 238          | 0,01              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar de Hong Kong – 3,37 % (suite)</b>                       |                  |                   |
| 2 445 000 Industrial & Commercial Bank of China Ltd               | 1 301 932        | 0,05              |
| 117 000 Innovent Biologics Inc                                    | 523 895          | 0,02              |
| 42 950 JD Health International Inc                                | 319 528          | 0,01              |
| 86 151 JD.com Inc   | 1 887 652        | 0,07              |
| 40 000 Jiangsu Expressway Co Ltd                                  | 37 300           | 0,00              |
| 28 000 Jiangxi Copper Co Ltd                                      | 47 440           | 0,00              |
| 72 000 Jiumaojiu International Holdings Ltd                       | 171 334          | 0,01              |
| 12 500 Kingboard Holdings Ltd                                     | 38 376           | 0,00              |
| 34 500 Kingboard Laminates Holdings Ltd                           | 36 038           | 0,00              |
| 129 000 Kingdee International Software Group Co Ltd               | 209 031          | 0,01              |
| 38 000 Kingsoft Corp Ltd  | 187 097          | 0,01              |
| 9 000 Koolearn Technology Holding Ltd                             | 38 809           | 0,00              |
| 93 500 Kuaishou Technology  | 720 014          | 0,03              |
| 274 000 Kunlun Energy Co Ltd                                      | 214 315          | 0,01              |
| 272 000 Lenovo Group Ltd  | 294 524          | 0,01              |
| 76 200 Li Auto Inc  | 951 293          | 0,04              |
| 98 000 Li Ning Co Ltd   | 772 769          | 0,03              |
| 138 500 Longfor Group Holdings Ltd                                | 390 802          | 0,02              |
| 187 810 Meituan   | 3 433 237        | 0,13              |
| 50 038 Microport Scientific Corp                                  | 117 670          | 0,01              |
| 56 319 MTR Corp Ltd   | 271 553          | 0,01              |
| 84 320 NetEase Inc  | 1 482 323        | 0,06              |
| 29 400 New China Life Insurance Co Ltd                            | 69 886           | 0,00              |
| 28 100 New Oriental Education & Technology Group Inc              | 109 537          | 0,00              |
| 93 034 New World Development Co Ltd                               | 249 475          | 0,01              |
| 35 000 Nine Dragons Paper Holdings Ltd                            | 26 217           | 0,00              |
| 222 000 People's Insurance Co Group of China Ltd                  | 74 095           | 0,00              |
| 1 040 000 PetroChina Co Ltd                                       | 616 055          | 0,02              |
| 13 050 Pharmaron Beijing Co Ltd                                   | 54 777           | 0,00              |
| 265 000 PICC Property & Casualty Co Ltd                           | 270 403          | 0,01              |
| 33 200 Ping An Healthcare and Technology Co Ltd                   | 83 994           | 0,00              |
| 301 500 Ping An Insurance Group Co of China Ltd                   | 1 962 643        | 0,07              |
| 12 000 Pop Mart International Group Ltd                           | 32 714           | 0,00              |
| 337 000 Postal Savings Bank of China Co Ltd                       | 200 055          | 0,01              |
| 60 000 Power Assets Holdings Ltd                                  | 321 786          | 0,01              |
| 130 400 Sands China Ltd   | 453 496          | 0,02              |
| 104 000 Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd              | 166 136          | 0,01              |
| 10 500 Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd                 | 29 828           | 0,00              |



## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Dollar de Hong Kong – 3,37 % (suite)</b>                       |                   |                   |
| 20 600 Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd                    | 38 419            | 0,00              |
| 32 005 Shenzhen International Holdings Ltd                        | 28 295            | 0,00              |
| 45 900 Shenzhou International Group Holdings Ltd                  | 481 807           | 0,02              |
| 36 000 Shima Group Holdings Ltd                                   | 5 068             | 0,00              |
| 707 000 Sino Biopharmaceutical Ltd                                | 396 283           | 0,02              |
| 158 500 Sino Land Co Ltd  | 214 431           | 0,01              |
| 46 000 Sinopharm Group Co Ltd                                     | 139 173           | 0,01              |
| 93 000 Smoore International Holdings Ltd                          | 119 420           | 0,01              |
| 86 511 Sun Hung Kai Properties Ltd                                | 1 212 264         | 0,05              |
| 267 000 Sunac China Holdings Ltd                                  | 38 945            | 0,00              |
| 34 969 Sunny Optical Technology Group Co Ltd                      | 422 972           | 0,02              |
| 19 500 Swire Pacific Ltd  | 149 791           | 0,01              |
| 47 800 Swire Properties Ltd                                       | 123 002           | 0,01              |
| 52 000 Techtronic Industries Co Ltd                               | 562 067           | 0,02              |
| 272 000 Tencent Holdings Ltd                                      | 13 367 932        | 0,51              |
| 50 000 Tingyi Cayman Islands Holding Corp                         | 83 313            | 0,00              |
| 25 000 TravelSky Technology Ltd                                   | 46 688            | 0,00              |
| 6 000 Tsingtao Brewery Co Ltd                                     | 65 504            | 0,00              |
| 45 000 Uni-President China Holdings Ltd                           | 45 402            | 0,00              |
| 139 000 Want Want China Holdings Ltd                              | 89 421            | 0,00              |
| 51 000 Weichai Power Co Ltd                                       | 81 860            | 0,00              |
| 253 708 WH Group Ltd  | 151 256           | 0,01              |
| 84 000 Wharf Real Estate Investment Co Ltd                        | 482 602           | 0,02              |
| 29 352 WuXi AppTec Co Ltd   | 307 357           | 0,01              |
| 132 646 Wuxi Biologics Cayman Inc                                 | 821 228           | 0,03              |
| 514 600 Xiaomi Corp   | 793 210           | 0,03              |
| 219 402 Xinyi Solar Holdings Ltd                                  | 263 005           | 0,01              |
| 12 900 XPeng Inc  | 71 895            | 0,00              |
| 66 000 Yadea Group Holdings Ltd                                   | 170 256           | 0,01              |
| 106 000 Yankuang Energy Group Co Ltd                              | 379 442           | 0,01              |
| 14 000 Yihai International Holding Ltd                            | 41 109            | 0,00              |
| 180 800 Yuexiu Property Co Ltd                                    | 272 699           | 0,01              |
| 28 000 Zhejiang Expressway Co Ltd                                 | 22 257            | 0,00              |
| 16 000 Zhongsheng Group Holdings Ltd                              | 78 880            | 0,00              |
| 18 000 Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd                         | 78 306            | 0,00              |
| 206 000 Zijin Mining Group Co Ltd                                 | 344 298           | 0,01              |
| 25 400 ZTE Corp (Class H)   | 74 421            | 0,00              |
|   | <b>88 792 032</b> | <b>3,37</b>       |
| <b>Forint hongrois – 0,02 %</b>                                   |                   |                   |
| 5 316 MOL Hungarian Oil & Gas PLC                                 | 38 934            | 0,00              |
| 9 210 OTP Bank Nyrt   | 262 605           | 0,01              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Forint hongrois – 0,02 % (suite)</b>                           |                  |                   |
| 5 248 Richter Gedeon Nyrt   | 109 807          | 0,01              |
|   | <b>411 346</b>   | <b>0,02</b>       |
| <b>Roupie indienne – 1,30 %</b>                                   |                  |                   |
| 13 405 Adani Enterprises Ltd                                      | 285 520          | 0,01              |
| 18 918 Adani Green Energy Ltd                                     | 202 836          | 0,01              |
| 17 866 Adani Ports & Special Economic Zone Ltd                    | 137 371          | 0,01              |
| 55 015 Adani Power Ltd  | 128 262          | 0,01              |
| 13 521 Adani Total Gas Ltd  | 142 766          | 0,01              |
| 16 762 Adani Transmission Ltd                                     | 202 543          | 0,01              |
| 15 000 Ambuja Cements Ltd   | 66 720           | 0,00              |
| 3 624 Apollo Hospitals Enterprise Ltd                             | 190 098          | 0,01              |
| 25 628 Asian Paints Ltd   | 861 200          | 0,03              |
| 9 569 Avenue Supermarts Ltd                                       | 396 005          | 0,02              |
| 136 103 Axis Bank Ltd   | 1 421 768        | 0,05              |
| 1 089 Bajaj Auto Ltd  | 51 477           | 0,00              |
| 11 178 Bajaj Finance Ltd  | 763 959          | 0,03              |
| 12 860 Bajaj Finserv Ltd  | 198 183          | 0,01              |
| 53 014 Bandhan Bank Ltd   | 126 274          | 0,00              |
| 33 241 Bharat Electronics Ltd                                     | 39 457           | 0,00              |
| 10 932 Bharat Forge Ltd   | 102 486          | 0,00              |
| 26 131 Bharat Petroleum Corp Ltd                                  | 109 475          | 0,00              |
| 58 505 Bharti Airtel Ltd  | 533 206          | 0,02              |
| 4 341 Britannia Industries Ltd                                    | 228 302          | 0,01              |
| 8 764 Cipla Ltd/India   | 96 030           | 0,00              |
| 29 755 Coal India Ltd   | 77 354           | 0,00              |
| 8 477 Container Corp Of India Ltd                                 | 59 852           | 0,00              |
| 24 808 Dabur India Ltd  | 164 486          | 0,01              |
| 3 111 Divi's Laboratories Ltd                                     | 106 877          | 0,00              |
| 17 979 DLF Ltd  | 78 035           | 0,00              |
| 3 874 Dr Reddy's Laboratories Ltd                                 | 217 912          | 0,01              |
| 5 474 Eicher Motors Ltd   | 196 417          | 0,01              |
| 58 878 GAIL India Ltd   | 75 333           | 0,00              |
| 8 265 Godrej Consumer Products Ltd                                | 97 366           | 0,00              |
| 715 Godrej Properties Ltd   | 8 970            | 0,00              |
| 5 839 Grasim Industries Ltd                                       | 116 002          | 0,00              |
| 5 812 Havells India Ltd   | 84 051           | 0,00              |
| 59 417 HCL Technologies Ltd                                       | 784 623          | 0,03              |
| 40 959 HDFC Life Insurance Co Ltd                                 | 248 797          | 0,01              |
| 4 803 Hero MotoCorp Ltd   | 137 186          | 0,01              |
| 63 010 Hindalco Industries Ltd                                    | 310 785          | 0,01              |
| 14 100 Hindustan Petroleum Corp Ltd                               | 40 628           | 0,00              |
| 28 431 Hindustan Unilever Ltd                                     | 885 752          | 0,03              |
| 76 729 Housing Development Finance Corp Ltd                       | 2 451 276        | 0,09              |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Roupie indienne – 1,30 % (suite)</b>                           |                  |                   |
| 195 509 ICICI Bank Ltd  | 2 086 944        | 0,08              |
| 2 929 ICICI Lombard General Insurance Co Ltd                      | 38 117           | 0,00              |
| 75 259 Indian Oil Corp Ltd  | 71 337           | 0,00              |
| 14 676 Indian Railway Catering & Tourism Corp Ltd                 | 102 290          | 0,00              |
| 34 142 Indus Towers Ltd   | 59 408           | 0,00              |
| 5 877 Info Edge India Ltd   | 266 277          | 0,01              |
| 47 366 Infosys Ltd  | 823 001          | 0,03              |
| 2 787 InterGlobe Aviation Ltd                                     | 64 795           | 0,00              |
| 218 060 ITC Ltd   | 1 017 565        | 0,04              |
| 41 094 JSW Steel Ltd  | 344 073          | 0,01              |
| 23 814 Jubilant Foodworks Ltd                                     | 127 528          | 0,00              |
| 31 336 Kotak Mahindra Bank Ltd                                    | 660 732          | 0,03              |
| 44 497 Larsen & Toubro Ltd  | 1 171 787        | 0,04              |
| 2 547 LTIMindtree Ltd   | 147 511          | 0,01              |
| 3 634 Lupin Ltd   | 28 671           | 0,00              |
| 42 428 Mahindra & Mahindra  | 598 197          | 0,02              |
| 17 869 Marico Ltd   | 104 323          | 0,00              |
| 9 920 Maruti Suzuki India Ltd                                     | 1 000 920        | 0,04              |
| 1 393 Mphasis Ltd   | 30 438           | 0,00              |
| 1 352 Nestle India Ltd  | 324 162          | 0,01              |
| 236 376 NTPC Ltd  | 503 628          | 0,02              |
| 85 847 Oil & Natural Gas Corp Ltd                                 | 157 785          | 0,01              |
| 123 Page Industries Ltd   | 56 729           | 0,00              |
| 12 235 Petronet LNG Ltd   | 34 070           | 0,00              |
| 2 454 Pidilite Industries Ltd                                     | 70 261           | 0,00              |
| 92 412 Power Grid Corp of India Ltd                               | 253 794          | 0,01              |
| 120 470 Reliance Industries Ltd                                   | 3 417 049        | 0,13              |
| 29 641 Samvardhana Motherson International Ltd                    | 24 201           | 0,00              |
| 25 626 SBI Life Insurance Co Ltd                                  | 343 343          | 0,01              |
| 434 Shree Cement Ltd  | 138 291          | 0,01              |
| 9 757 Shriram Finance Ltd   | 149 520          | 0,01              |
| 7 221 SRF Ltd   | 211 918          | 0,01              |
| 68 289 State Bank of India  | 435 207          | 0,02              |
| 40 941 Sun Pharmaceutical Industries Ltd                          | 489 753          | 0,02              |
| 38 561 Tata Consultancy Services Ltd                              | 1 504 246        | 0,06              |
| 24 004 Tata Consumer Products Ltd                                 | 207 042          | 0,01              |
| 2 280 Tata Elxsi Ltd  | 165 324          | 0,01              |
| 80 945 Tata Motors Ltd  | 414 464          | 0,02              |
| 85 528 Tata Power Co Ltd  | 197 995          | 0,01              |
| 360 920 Tata Steel Ltd  | 458 931          | 0,02              |
| 19 644 Tech Mahindra Ltd  | 263 374          | 0,01              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Roupie indienne – 1,30 % (suite)</b>                           |                   |                   |
| 14 303 Titan Co Ltd   | 437 692           | 0,02              |
| 10 713 UltraTech Cement Ltd                                       | 993 595           | 0,04              |
| 15 076 United Spirits Ltd   | 138 740           | 0,01              |
| 19 164 UPL Ltd  | 167 348           | 0,01              |
| 5 665 Varun Beverages Ltd   | 95 609            | 0,00              |
| 239 778 Vedanta Ltd   | 800 743           | 0,03              |
| 106 228 Wipro Ltd   | 472 117           | 0,02              |
| 959 437 Yes Bank Ltd  | 175 701           | 0,01              |
| 95 707 Zomato Ltd   | 59 393            | 0,00              |
|   | <b>34 331 579</b> | <b>1,30</b>       |
| <b>Roupie indonésienne – 0,23 %</b>                               |                   |                   |
| 1 369 100 Adaro Energy Indonesia Tbk PT                           | 264 790           | 0,01              |
| 677 000 Astra International Tbk PT                                | 270 899           | 0,01              |
| 3 112 400 Bank Central Asia Tbk PT                                | 1 816 233         | 0,07              |
| 627 000 Bank Mandiri Persero Tbk PT                               | 431 743           | 0,02              |
| 209 200 Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT                      | 130 449           | 0,01              |
| 4 692 727 Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT                    | 1 480 316         | 0,06              |
| 210 300 Charoen Pokphand Indonesia Tbk PT                         | 69 985            | 0,00              |
| 92 600 Indah Kiat Pulp & Paper Tbk PT                             | 46 317            | 0,00              |
| 78 800 Indofood Sukses Makmur Tbk PT                              | 32 583            | 0,00              |
| 868 800 Kalbe Farma Tbk PT  | 121 677           | 0,00              |
| 451 900 Merdeka Copper Gold Tbk PT                                | 126 277           | 0,00              |
| 58 961 Semen Indonesia Persero Tbk PT                             | 24 773            | 0,00              |
| 118 900 Sumber Alfaria Trijaya Tbk PT                             | 22 837            | 0,00              |
| 3 917 500 Telkom Indonesia Persero Tbk PT                         | 1 060 726         | 0,04              |
| 177 500 Unilever Indonesia Tbk PT                                 | 51 494            | 0,00              |
| 82 000 United Tractors Tbk PT                                     | 159 138           | 0,01              |
|   | <b>6 110 237</b>  | <b>0,23</b>       |
| <b>Nouveau shekel israélien – 0,09 %</b>                          |                   |                   |
| 1 098 Azrieli Group Ltd   | 62 758            | 0,00              |
| 45 610 Bank Hapoalim BM   | 376 848           | 0,01              |
| 53 978 Bank Leumi Le-Israel BM                                    | 404 762           | 0,02              |
| 20 374 Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd               | 27 647            | 0,00              |
| 801 Elbit Systems Ltd   | 135 478           | 0,00              |
| 32 067 ICL Group Ltd  | 214 899           | 0,01              |
| - Isracard Ltd  | 1                 | 0,00              |
| 33 914 Israel Discount Bank Ltd                                   | 165 301           | 0,01              |
| 4 809 Mizrahi Tefahot Bank Ltd                                    | 149 854           | 0,01              |
| 2 699 Nice Ltd  | 603 567           | 0,02              |
| 4 073 Tower Semiconductor Ltd                                     | 173 071           | 0,01              |
|   | <b>2 314 186</b>  | <b>0,09</b>       |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Yen japonais – 5,39 %</b>                                      |                  |                   |
| 11 700 Advantest Corp   | 1 068 991        | 0,04              |
| 27 000 Aeon Co Ltd  | 520 565          | 0,02              |
| 3 800 AGC Inc   | 140 619          | 0,01              |
| 5 900 Aisin Corp  | 161 586          | 0,01              |
| 14 600 Ajinomoto Co Inc   | 505 279          | 0,02              |
| 5 800 ANA Holdings Inc  | 125 335          | 0,01              |
| 16 500 Asahi Group Holdings Ltd                                   | 610 459          | 0,02              |
| 7 000 Asahi Intecc Co Ltd   | 122 233          | 0,00              |
| 58 500 Asahi Kasei Corp   | 407 157          | 0,02              |
| 81 300 Astellas Pharma  | 1 150 258        | 0,04              |
| 5 600 Azbil   | 151 897          | 0,01              |
| 29 100 Bandai Namco Holdings Inc                                  | 622 822          | 0,02              |
| 26 600 Bridgestone Corp   | 1 072 674        | 0,04              |
| 4 900 Brother Industries Ltd                                      | 73 340           | 0,00              |
| 45 400 Canon Inc  | 1 008 188        | 0,04              |
| 8 000 Capcom Co Ltd   | 284 619          | 0,01              |
| 9 197 Central Japan Railway Co                                    | 1 092 528        | 0,04              |
| 17 000 Chiba Bank Ltd   | 109 212          | 0,00              |
| 21 700 Chubu Electric Power Co Inc                                | 228 104          | 0,01              |
| 38 700 Chugai Pharmaceutical Co Ltd                               | 950 853          | 0,04              |
| 27 400 Concordia Financial Group Ltd                              | 100 467          | 0,00              |
| 8 800 CyberAgent Inc  | 73 725           | 0,00              |
| 6 300 Dai Nippon Printing Co Ltd                                  | 175 381          | 0,01              |
| 7 800 Daifuku Co Ltd  | 143 177          | 0,01              |
| 63 800 Dai-ichi Life Holdings Inc                                 | 1 167 278        | 0,04              |
| 70 000 Daiichi Sankyo Co Ltd                                      | 2 536 179        | 0,10              |
| 13 400 Daikin Industries Ltd                                      | 2 381 674        | 0,09              |
| 2 500 Daito Trust Construction Co Ltd                             | 247 765          | 0,01              |
| 32 200 Daiwa House Industry Co Ltd                                | 753 406          | 0,03              |
| 58 800 Daiwa Securities Group Inc                                 | 274 362          | 0,01              |
| 17 800 Denso Corp   | 995 457          | 0,04              |
| 8 100 Dentsu Group Inc  | 283 004          | 0,01              |
| 2 400 Disco Corp  | 275 903          | 0,01              |
| 16 700 East Japan Railway Co                                      | 920 388          | 0,04              |
| 14 800 Eisai Co Ltd   | 834 467          | 0,03              |
| 151 700 ENEOS Holdings Inc  | 530 249          | 0,02              |
| 63 500 FANUC Corp   | 2 271 095        | 0,09              |
| 6 000 Fast Retailing Co Ltd                                       | 1 301 976        | 0,05              |
| 5 900 Fuji Electric Co Ltd  | 230 521          | 0,01              |
| 15 100 FUJIFILM Holdings Corp                                     | 759 935          | 0,03              |
| 7 600 Fujitsu Ltd   | 1 018 454        | 0,04              |
| 1 000 GMO Payment Gateway Inc                                     | 85 506           | 0,00              |
| 3 200 Hakuodo DY Holdings Inc                                     | 35 946           | 0,00              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Yen japonais – 5,39 % (suite)</b>                              |                  |                   |
| 7 100 Hamamatsu Photonics KK                                      | 379 300          | 0,01              |
| 15 200 Hankyu Hanshin Holdings Inc                                | 448 268          | 0,02              |
| 500 Hikari Tsushin Inc  | 69 765           | 0,00              |
| 1 300 Hirose Electric Co Ltd                                      | 168 690          | 0,01              |
| 1 400 Hitachi Construction Machinery Co Ltd                       | 32 347           | 0,00              |
| 42 400 Hitachi Ltd  | 2 310 352        | 0,09              |
| 55 700 Honda Motor Co Ltd   | 1 468 983        | 0,06              |
| 3 000 Hoshizaki Corp  | 110 113          | 0,00              |
| 13 800 Hoya Corp  | 1 509 715        | 0,06              |
| 7 900 Hulic Co Ltd  | 64 522           | 0,00              |
| 2 100 Ibiben Co Ltd   | 82 996           | 0,00              |
| 6 191 Idemitsu Kosan Co Ltd                                       | 134 900          | 0,01              |
| 6 000 Iida Group Holdings Co Ltd                                  | 97 333           | 0,00              |
| 36 600 Inpex Corp   | 384 178          | 0,01              |
| 21 600 Isuzu Motors Ltd   | 256 266          | 0,01              |
| 51 700 ITOCHU Corp  | 1 670 762        | 0,06              |
| 1 900 Itochu Techno-Solutions                                     | 46 469           | 0,00              |
| 3 400 Japan Airlines Co Ltd                                       | 65 961           | 0,00              |
| 31 300 Japan Exchange Group Inc                                   | 474 709          | 0,02              |
| 65 000 Japan Post Bank Co Ltd                                     | 528 928          | 0,02              |
| 70 200 Japan Post Holdings Co Ltd                                 | 567 813          | 0,02              |
| 54 100 Japan Tobacco Inc  | 1 137 364        | 0,04              |
| 19 900 JFE Holdings Inc   | 251 049          | 0,01              |
| 4 300 JSR Corp  | 100 642          | 0,00              |
| 16 400 Kajima Corp  | 196 913          | 0,01              |
| 25 200 Kansai Electric Power Co Inc                               | 244 445          | 0,01              |
| 13 800 Kao Corp   | 535 762          | 0,02              |
| 72 000 KDDI Corp  | 2 214 261        | 0,08              |
| 2 600 Keio Corp   | 90 743           | 0,00              |
| 2 700 Keisei Electric Railway                                     | 82 670           | 0,00              |
| 9 500 Keyence   | 4 600 458        | 0,17              |
| 5 300 Kikkoman Corp   | 268 405          | 0,01              |
| 4 300 Kintetsu Group Holdings Co Ltd                              | 137 798          | 0,01              |
| 34 700 Kirin Holdings Co Ltd                                      | 546 481          | 0,02              |
| 1 900 Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd                             | 115 493          | 0,00              |
| 3 500 Kobe Bussan Co Ltd  | 96 908           | 0,00              |
| 7 600 Koito Manufacturing   | 142 761          | 0,01              |
| 37 100 Komatsu Ltd  | 913 492          | 0,04              |
| 1 800 Konami Group Corp   | 82 095           | 0,00              |
| 1 200 Kose Corp   | 141 378          | 0,01              |
| 44 900 Kubota Corp  | 674 394          | 0,03              |
| 3 200 Kurita Water Industries                                     | 145 225          | 0,01              |
| 14 000 Kyocera  | 724 562          | 0,03              |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Yen japonais – 5,39 % (suite)</b>                              |                  |                   | <b>Yen japonais – 5,39 % (suite)</b>                              |                  |                   |
| 6 900 Kyowa Kirin Co Ltd  | 149 624          | 0,01              | 12 500 Nitto Denko Corp   | 803 028          | 0,03              |
| 3 400 Lasertec Corp   | 594 725          | 0,02              | 200 300 Nomura Holdings Inc                                       | 767 097          | 0,03              |
| 6 500 Lixil Corp  | 106 323          | 0,00              | 4 400 Nomura Real Estate Holdings Inc                             | 96 867           | 0,00              |
| 18 000 M3 Inc   | 446 450          | 0,02              | 10 800 Nomura Research Institute Ltd                              | 248 719          | 0,01              |
| 8 100 Makita Corp   | 199 624          | 0,01              | 21 300 NTT Data Corp  | 277 193          | 0,01              |
| 100 800 Marubeni Corp   | 1 359 880        | 0,05              | 22 600 Obayashi Corp  | 172 017          | 0,01              |
| 13 800 Mazda Motor Corp   | 127 019          | 0,01              | 2 200 Obic Co Ltd   | 345 480          | 0,01              |
| 3 000 McDonald's Holdings Co Japan Ltd                            | 124 427          | 0,01              | 13 400 Odakyu Electric Railway Co Ltd                             | 173 176          | 0,01              |
| 8 600 MEIJI Holdings Co Ltd                                       | 203 870          | 0,01              | 29 200 Oji Holdings Corp  | 114 966          | 0,00              |
| 13 200 MINEBEA MITSUMI Inc  | 249 043          | 0,01              | 52 000 Olympus  | 905 868          | 0,03              |
| 16 400 MISUMI Group Inc   | 406 642          | 0,02              | 7 800 Omron   | 451 684          | 0,02              |
| 85 100 Mitsubishi Chemical Group Corp                             | 502 390          | 0,02              | 29 300 Ono Pharmaceutical   | 608 499          | 0,02              |
| 58 400 Mitsubishi Corp  | 2 084 743        | 0,08              | 900 Oracle Corp Japan   | 64 445           | 0,00              |
| 78 100 Mitsubishi Electric Corp                                   | 926 297          | 0,04              | 70 500 Oriental Land Co Ltd/Japan                                 | 2 398 557        | 0,09              |
| 65 600 Mitsubishi Estate Co Ltd                                   | 777 056          | 0,03              | 68 900 ORIX   | 1 126 763        | 0,04              |
| 20 600 Mitsubishi HC Capital Inc                                  | 105 871          | 0,00              | 12 500 Osaka Gas Co Ltd   | 204 843          | 0,01              |
| 19 500 Mitsubishi Heavy Industries Ltd                            | 714 419          | 0,03              | 2 600 Otsuka Corp   | 91 525           | 0,00              |
| 502 400 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc                        | 3 200 729        | 0,12              | 18 700 Otsuka Holdings Co Ltd                                     | 590 548          | 0,02              |
| 58 300 Mitsui & Co Ltd  | 1 803 011        | 0,07              | 17 200 Pan Pacific International Holdings Corp                    | 330 715          | 0,01              |
| 5 800 Mitsui Chemicals Inc  | 148 606          | 0,01              | 97 900 Panasonic Holdings Corp                                    | 869 470          | 0,03              |
| 48 900 Mitsui Fudosan   | 912 673          | 0,03              | 5 400 Persol Holdings Co Ltd                                      | 107 683          | 0,00              |
| 16 500 Mitsui OSK Lines Ltd                                       | 410 361          | 0,02              | 29 700 Rakuten  | 137 019          | 0,01              |
| 93 600 Mizuho Financial Group Inc                                 | 1 320 766        | 0,05              | 56 800 Recruit Holdings Co Ltd                                    | 1 557 743        | 0,06              |
| 5 000 MonotaRO Co Ltd   | 62 251           | 0,00              | 33 900 Renesas Electronics Corp                                   | 487 397          | 0,02              |
| 29 600 MS&AD Insurance Group Holdings Inc                         | 913 199          | 0,03              | 79 400 Resona Holdings Inc  | 381 518          | 0,01              |
| 28 800 Murata Manufacturing Co Ltd                                | 1 739 815        | 0,07              | 19 900 Ricoh Co Ltd   | 148 177          | 0,01              |
| 15 100 NEC  | 578 631          | 0,02              | 3 100 Rohm Co Ltd   | 255 519          | 0,01              |
| 26 000 Nexon Co Ltd   | 616 350          | 0,02              | 8 700 SBI Holdings Inc  | 171 529          | 0,01              |
| 3 200 NGK Insulators  | 42 125           | 0,00              | 13 700 Secom Co Ltd   | 840 385          | 0,03              |
| 16 200 Nidec Corp   | 833 188          | 0,03              | 6 900 Seiko Epson Corp  | 97 520           | 0,00              |
| 13 800 Nihon M&A Center Holdings Inc                              | 102 030          | 0,00              | 23 500 Sekisui Chemical   | 331 250          | 0,01              |
| 57 000 Nintendo Co Ltd  | 2 197 513        | 0,08              | 27 500 Sekisui House Ltd  | 557 480          | 0,02              |
| 2 400 Nippon Express Holdings Inc                                 | 143 722          | 0,01              | 29 000 Seven & i Holdings Co Ltd                                  | 1 301 939        | 0,05              |
| 56 700 Nippon Paint Holdings Co Ltd                               | 527 422          | 0,02              | 6 800 SG Holdings Co Ltd  | 100 143          | 0,00              |
| 2 000 Nippon Sanso Holdings Corp                                  | 35 795           | 0,00              | 4 700 Sharp Corp/Japan  | 32 948           | 0,00              |
| 43 900 Nippon Steel Corp  | 1 029 138        | 0,04              | 6 000 Shimadzu Corp   | 186 641          | 0,01              |
| 54 500 Nippon Telegraph & Telephone Corp                          | 1 622 428        | 0,06              | 2 700 Shimano Inc   | 463 356          | 0,02              |
| 16 700 Nippon Yusen KK  | 387 605          | 0,02              | 18 700 Shimizu Corp   | 105 380          | 0,00              |
| 4 200 Nissan Chemical Corp  | 189 030          | 0,01              | 66 000 Shin-Etsu Chemical Co Ltd                                  | 2 119 994        | 0,08              |
| 115 700 Nissan Motor Co Ltd                                       | 435 625          | 0,02              | 16 100 Shionogi & Co Ltd  | 723 042          | 0,03              |
| 4 800 Nisshin Seifun Group Inc                                    | 55 938           | 0,00              | 15 200 Shiseido   | 705 922          | 0,03              |
| 2 700 Nissin Foods Holdings Co Ltd                                | 246 082          | 0,01              | 8 900 Shizuoka Financial Group Inc                                | 63 595           | 0,00              |
| 2 900 Nitori Holdings Co Ltd                                      | 347 111          | 0,01              | 2 000 SMC Corp  | 1 049 365        | 0,04              |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Yen japonais – 5,39 % (suite)</b>                              |                  |                   |
| 93 400 SoftBank Corp  | 1 073 023        | 0,04              |
| 51 300 SoftBank Group   | 1 997 420        | 0,08              |
| 18 600 Sompo Holdings Inc   | 733 994          | 0,03              |
| 52 200 Sony   | 4 700 706        | 0,18              |
| 300 Square Enix Holdings Co Ltd                                   | 14 336           | 0,00              |
| 37 300 Subaru Corp  | 592 613          | 0,02              |
| 5 300 SUMCO Corp  | 78 889           | 0,00              |
| 128 900 Sumitomo Chemical Co Ltd                                  | 430 990          | 0,02              |
| 32 600 Sumitomo Corp  | 573 421          | 0,02              |
| 45 200 Sumitomo Electric Industries Ltd                           | 576 335          | 0,02              |
| 10 600 Sumitomo Metal Mining                                      | 402 129          | 0,02              |
| 45 900 Sumitomo Mitsui Financial Group Inc                        | 1 827 171        | 0,07              |
| 18 500 Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc                         | 631 216          | 0,02              |
| 17 000 Sumitomo Realty & Development Co Ltd                       | 380 900          | 0,01              |
| 4 900 Suntory Beverage & Food Ltd                                 | 181 693          | 0,01              |
| 18 000 Suzuki Motor Corp  | 649 726          | 0,02              |
| 12 400 Sysmex Corp  | 805 269          | 0,03              |
| 14 000 T&D Holdings Inc   | 172 620          | 0,01              |
| 7 500 Taisei Corp   | 230 765          | 0,01              |
| 62 848 Takeda Pharmaceutical Co Ltd                               | 2 054 165        | 0,08              |
| 31 800 TDK  | 1 128 973        | 0,04              |
| 25 500 Terumo   | 684 777          | 0,03              |
| 10 200 TIS Inc  | 267 473          | 0,01              |
| 10 300 Tobu Railway Co Ltd  | 245 330          | 0,01              |
| 2 600 Toho Co Ltd/Tokyo   | 99 046           | 0,00              |
| 93 300 Tokio Marine Holdings Inc                                  | 1 785 522        | 0,07              |
| 51 000 Tokyo Electric Power Co Holdings Inc                       | 181 253          | 0,01              |
| 21 900 Tokyo Electron Ltd   | 2 639 387        | 0,10              |
| 20 000 Tokyo Gas Co Ltd   | 375 085          | 0,01              |
| 14 000 Tokyu Corp   | 185 348          | 0,01              |
| 7 600 TOPPAN INC  | 152 183          | 0,01              |
| 53 600 Toray Industries Inc                                       | 304 629          | 0,01              |
| 26 100 Toshiba Corp   | 871 700          | 0,03              |
| 8 300 Tosoh Corp  | 112 068          | 0,00              |
| 3 000 TOTO Ltd  | 99 632           | 0,00              |
| 5 300 Toyota Industries Corp                                      | 292 697          | 0,01              |
| 467 500 Toyota Motor  | 6 603 802        | 0,25              |
| 8 500 Toyota Tsusho Corp  | 358 930          | 0,01              |
| 4 700 Trend Micro Inc/Japan                                       | 228 484          | 0,01              |
| 20 800 Unicharm Corp  | 850 348          | 0,03              |
| 5 900 USS Co Ltd  | 101 739          | 0,00              |
| 1 800 Welcia Holdings Co Ltd                                      | 38 329           | 0,00              |
| 10 600 West Japan Railway Co                                      | 434 625          | 0,02              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|---|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Yen japonais – 5,39 % (suite)</b>                              |                    |                   |
| 5 800 Yakult Honsha Co Ltd  | 419 671            | 0,02              |
| 4 900 Yamaha Corp   | 187 399            | 0,01              |
| 7 900 Yamaha Motor Co Ltd   | 205 380            | 0,01              |
| 12 000 Yamato Holdings Co Ltd                                     | 204 583            | 0,01              |
| 12 300 Yaskawa Electric   | 533 256            | 0,02              |
| 8 600 Yokogawa Electric   | 138 929            | 0,01              |
| 165 900 Z Holdings Corp   | 464 704            | 0,02              |
| 2 600 ZOZO Inc  | 58 900             | 0,00              |
|   | <b>142 026 818</b> | <b>5,39</b>       |
| <b>Dinar koweïtien – 0,09 %</b>                                   |                    |                   |
| 246 420 Kuwait Finance House KSCP                                 | 663 330            | 0,03              |
| 466 350 National Bank of Kuwait SAKP                              | 1 604 907          | 0,06              |
|   | <b>2 268 237</b>   | <b>0,09</b>       |
| <b>Ringgit malais – 0,14 %</b>                                    |                    |                   |
| 27 400 AMMB Holdings Bhd  | 23 286             | 0,00              |
| 70 099 Axiata Group Bhd   | 47 818             | 0,00              |
| 459 195 CIMB Group Holdings Bhd                                   | 552 595            | 0,02              |
| 211 996 Dialog Group Bhd  | 113 385            | 0,01              |
| 75 100 DiGi.Com Bhd   | 73 866             | 0,00              |
| 51 900 Genting Bhd  | 54 811             | 0,00              |
| 88 400 Genting Malaysia Bhd                                       | 53 090             | 0,00              |
| 7 100 HAP Seng Consolidated Bhd                                   | 8 206              | 0,00              |
| 10 400 Hong Leong Bank Bhd  | 47 657             | 0,00              |
| 66 200 IHH Healthcare Bhd   | 86 266             | 0,01              |
| 9 240 Kuala Lumpur Kepong Bhd                                     | 43 515             | 0,00              |
| 293 572 Malayan Banking Bhd                                       | 570 179            | 0,02              |
| 23 010 Malaysia Airports Holdings Bhd                             | 35 408             | 0,00              |
| 51 400 Maxis Bhd  | 48 109             | 0,00              |
| 1 400 Nestle Malaysia Bhd   | 43 499             | 0,00              |
| 121 700 Petronas Chemicals Group Bhd                              | 194 996            | 0,01              |
| 6 600 Petronas Dagangan Bhd                                       | 31 919             | 0,00              |
| 10 900 Petronas Gas Bhd   | 40 710             | 0,00              |
| 15 000 PPB Group Bhd  | 56 295             | 0,00              |
| 70 400 Press Metal Aluminium Holdings Bhd                         | 77 699             | 0,01              |
| 1 108 300 Public Bank Bhd   | 1 004 691          | 0,04              |
| 36 450 QL Resources Bhd   | 47 994             | 0,00              |
| 98 500 Sime Darby Bhd   | 47 994             | 0,00              |
| 35 382 Sime Darby Plantation Bhd                                  | 34 240             | 0,00              |
| 65 878 Telekom Malaysia Bhd                                       | 73 156             | 0,00              |
| 159 300 Tenaga Nasional Bhd                                       | 333 221            | 0,01              |
| 440 900 Top Glove Corp Bhd  | 93 926             | 0,01              |
|   | <b>3 838 531</b>   | <b>0,14</b>       |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Peso mexicain – 0,27 %</b>                                     |                  |                   | <b>Nouveau dollar de Taïwan – 1,66 %</b>                          |                  |                   |
| 1 591 841 America Movil SAB de CV                                 | 1 668 894        | 0,06              | 22 000 Accton Technology Corp                                     | 230 495          | 0,01              |
| 8 300 Arca Continental SAB de CV                                  | 75 222           | 0,00              | 66 000 Acer Inc   | 61 020           | 0,00              |
| 563 426 Cemex Unit NPV  | 308 611          | 0,01              | 6 599 Advantech Co Ltd  | 80 408           | 0,00              |
| 10 400 Coca-Cola Femsa SAB de CV Unit NPV                         | 83 363           | 0,00              | 4 185 Airtac International Group                                  | 162 878          | 0,01              |
| 50 586 Fomento Economico Mexicano Unit NPV                        | 481 318          | 0,02              | 122 124 ASE Technology Holding Co Ltd                             | 451 234          | 0,02              |
| 4 720 Gruma SAB de CV   | 69 493           | 0,00              | 45 000 Asia Cement Corp   | 63 995           | 0,00              |
| 13 500 Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV                 | 262 142          | 0,01              | 48 000 Asustek Computer Inc                                       | 429 592          | 0,02              |
| 5 900 Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV                   | 180 117          | 0,01              | 332 800 AUO Corp  | 201 117          | 0,01              |
| 35 100 Grupo Bimbo SAB de CV                                      | 176 278          | 0,01              | 20 000 Catcher Technology Co Ltd                                  | 124 805          | 0,01              |
| 15 700 Grupo Carso SAB de CV                                      | 77 874           | 0,00              | 337 047 Cathay Financial Holding Co Ltd                           | 462 717          | 0,02              |
| 152 200 Grupo Financiero Banorte SAB de CV                        | 1 280 415        | 0,05              | 83 184 Chailease Holding Co Ltd                                   | 610 612          | 0,02              |
| 34 900 Grupo Financiero Inbursa SAB de CV                         | 74 899           | 0,00              | 76 384 Chang Hwa Commercial Bank Ltd                              | 43 526           | 0,00              |
| 179 758 Grupo Mexico SAB de CV                                    | 849 510          | 0,03              | 34 000 Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd                          | 40 814           | 0,00              |
| 82 960 Grupo Televisa Unit NPV                                    | 87 619           | 0,01              | 167 000 China Airlines Ltd  | 106 955          | 0,00              |
| 5 205 Industrias Penoles SAB de CV                                | 76 622           | 0,00              | 300 000 China Development Financial Holding Corp                  | 123 655          | 0,01              |
| 76 400 Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV                         | 160 619          | 0,01              | 890 403 China Steel Corp  | 903 636          | 0,03              |
| 35 500 Orbia Advance Corp SAB de CV                               | 77 032           | 0,00              | 228 000 Chunghwa Telecom Co Ltd                                   | 894 852          | 0,03              |
| 7 060 Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV          | 70 362           | 0,00              | 87 000 Compal Electronics Inc                                     | 72 149           | 0,00              |
| 291 583 Wal-Mart de Mexico SAB de CV                              | 1 163 199        | 0,05              | 920 560 CTBC Financial Holding Co Ltd                             | 660 620          | 0,03              |
|   | <b>7 223 589</b> | <b>0,27</b>       | 97 000 Delta Electronics Inc                                      | 958 929          | 0,04              |
|   |                  |                   | 37 000 E Ink Holdings Inc   | 224 206          | 0,01              |
|   |                  |                   | 542 725 E.Sun Financial Holding Co Ltd                            | 450 971          | 0,02              |
|   |                  |                   | 4 535 Eclat Textile Co Ltd  | 73 728           | 0,00              |
|   |                  |                   | 4 000 eMemory Technology Inc                                      | 244 355          | 0,01              |
| <b>Nouveau rouble russe – 0,00 %</b>                              |                  |                   | 106 000 Eva Airways Corp  | 93 476           | 0,00              |
| 110 150 Alrosa PJSC   | -                | 0,00              | 87 980 Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd                           | 457 996          | 0,02              |
| 627 056 Gazprom PJSC  | -                | 0,00              | 76 000 Far Eastern New Century Corp                               | 78 128           | 0,00              |
| 841 000 Inter RAO UES PJSC  | -                | 0,00              | 38 000 Far EastTone Telecommunications Co Ltd                     | 93 853           | 0,00              |
| 25 800 LUKOIL PJSC  | -                | 0,00              | 16 572 Feng TAY Enterprise Co Ltd                                 | 105 046          | 0,00              |
| 5 697 Magnit PJSC   | -                | 0,00              | 218 532 First Financial Holding Co Ltd                            | 189 841          | 0,01              |
| 3 767 MMC Norilsk Nickel PJSC                                     | -                | 0,00              | 343 190 Formosa Chemicals & Fibre Corp                            | 778 863          | 0,03              |
| 15 870 Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC                             | -                | 0,00              | 25 000 Formosa Petrochemical Corp                                 | 69 792           | 0,00              |
| 59 260 Novatek PJSC   | -                | 0,00              | 160 960 Formosa Plastics Corp                                     | 485 299          | 0,02              |
| 52 410 Novolipetsk Steel PJSC                                     | -                | 0,00              | 295 827 Fubon Financial Holding Co Ltd                            | 548 952          | 0,02              |
| 1 188 Polyus PJSC   | -                | 0,00              | 18 000 Giant Manufacturing Co Ltd                                 | 104 048          | 0,00              |
| 41 603 Rosneft Oil Co PJSC  | -                | 0,00              | 10 000 Globalwafers Co Ltd  | 170 129          | 0,01              |
| 623 763 Sberbank of Russia PJSC                                   | -                | 0,00              | 662 118 Hon Hai Precision Industry Co Ltd                         | 2 261 607        | 0,09              |
| 3 000 Severstal PAO   | -                | 0,00              | 8 000 Hotai Motor Co Ltd  | 168 684          | 0,01              |
| 106 900 Surgutneftegas PJSC                                       | -                | 0,00              | 154 664 Hua Nan Financial Holdings Co Ltd                         | 113 531          | 0,00              |
| 107 125 Tatneft PJSC  | -                | 0,00              | 190 989 Innolux Corp  | 90 955           | 0,00              |
| 127 310 000 VTB Bank PJSC   | -                | 0,00              | 53 000 Inventec Corp  | 55 615           | 0,00              |
| 13 000 Yandex NV  | -                | 0,00              | 4 000 Largan Precision Co Ltd                                     | 285 738          | 0,01              |
|   |                  | <b>0,00</b>       |   |                  |                   |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Nouveau dollar de Taïwan – 1,66 % (suite)</b>                  |                  |                   |
| 46 000 Lite-On Technology Corp                                    | 110 741          | 0,00              |
| 64 000 MediaTek Inc   | 1 654 257        | 0,06              |
| 894 825 Mega Financial Holding Co Ltd                             | 969 841          | 0,04              |
| 34 000 Micro-Star International Co Ltd                            | 160 801          | 0,01              |
| 3 600 momo.com Inc  | 106 767          | 0,00              |
| 541 470 Nan Ya Plastics Corp                                      | 1 378 239        | 0,05              |
| 10 000 Nan Ya Printed Circuit Board Corp                          | 92 947           | 0,00              |
| 34 000 Nanya Technology Corp                                      | 74 259           | 0,00              |
| 8 000 Nien Made Enterprise Co Ltd                                 | 85 918           | 0,00              |
| 12 000 Novatek Microelectronics Corp                              | 170 063          | 0,01              |
| 47 000 Pegatron Corp  | 107 592          | 0,00              |
| 2 000 PharmaEssentia Corp   | 28 114           | 0,00              |
| 39 000 Pou Chen Corp  | 39 964           | 0,00              |
| 25 000 President Chain Store Corp                                 | 221 283          | 0,01              |
| 54 000 Quanta Computer Inc  | 158 023          | 0,01              |
| 14 000 Realtek Semiconductor Corp                                 | 178 176          | 0,01              |
| 111 368 Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd                    | 171 729          | 0,01              |
| 136 777 Shin Kong Financial Holding Co Ltd                        | 37 825           | 0,00              |
| 8 000 Silergy Corp  | 125 987          | 0,01              |
| 156 288 SinoPac Financial Holdings Co Ltd                         | 85 208           | 0,00              |
| 259 755 Taishin Financial Holding Co Ltd                          | 141 619          | 0,01              |
| 407 885 Taiwan Cement Corp  | 487 627          | 0,02              |
| 185 099 Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd               | 158 669          | 0,01              |
| 38 000 Taiwan High Speed Rail Corp                                | 37 753           | 0,00              |
| 41 000 Taiwan Mobile Co Ltd                                       | 136 005          | 0,01              |
| 1 085 825 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd               | 19 007 955       | 0,72              |
| 46 000 Unimicron Technology Corp                                  | 222 843          | 0,01              |
| 426 000 Uni-President Enterprises Corp                            | 1 005 974        | 0,04              |
| 393 000 United Microelectronics Corp                              | 682 805          | 0,03              |
| 24 000 Vanguard International Semiconductor Corp                  | 76 381           | 0,00              |
| 3 000 Voltronic Power Technology Corp                             | 170 457          | 0,01              |
| 80 000 Walsin Lihwa Corp  | 128 089          | 0,01              |
| 44 965 Wan Hai Lines Ltd  | 101 161          | 0,00              |
| 10 000 Win Semiconductors Corp                                    | 59 939           | 0,00              |
| 100 000 Winbond Electronics Corp                                  | 87 035           | 0,00              |
| 6 000 Winyann Corp  | 221 693          | 0,01              |
| 5 721 Yageo Corp  | 99 398           | 0,00              |
| 89 000 Yang Ming Marine Transport Corp                            | 187 953          | 0,01              |
| 1 133 487 Yuanta Financial Holding Co Ltd                         | 832 037          | 0,03              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Nouveau dollar de Taïwan – 1,66 % (suite)</b>                  |                   |                   |
| 17 000 Zhen Ding Technology Holding Ltd                           | 63 651            | 0,00              |
|   | <b>43 695 600</b> | <b>1,66</b>       |
| <b>Dollar néo-zélandais – 0,06 %</b>                              |                   |                   |
| 46 475 Auckland International Airport Ltd                         | 252 971           | 0,01              |
| 31 595 Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd                        | 526 801           | 0,02              |
| 60 233 Meridian Energy Ltd  | 197 845           | 0,01              |
| 164 402 Spark New Zealand Ltd                                     | 520 462           | 0,02              |
|   | <b>1 498 079</b>  | <b>0,06</b>       |
| <b>Couronne norvégienne – 0,18 %</b>                              |                   |                   |
| 11 557 Adevinta ASA   | 81 934            | 0,00              |
| 5 910 Aker BP ASA   | 144 631           | 0,01              |
| 49 596 DNB Bank ASA   | 887 207           | 0,03              |
| 55 926 Equinor ASA  | 1 595 048         | 0,06              |
| 6 265 Gjensidige Forsikring ASA                                   | 102 472           | 0,00              |
| 22 135 Mowi ASA   | 408 753           | 0,02              |
| 58 248 Norsk Hydro ASA  | 432 698           | 0,02              |
| 32 158 Orkla ASA  | 228 018           | 0,01              |
| 38 492 Telenor ASA  | 450 962           | 0,02              |
| 6 930 Yara International ASA                                      | 300 343           | 0,01              |
|   | <b>4 632 066</b>  | <b>0,18</b>       |
| <b>Peso philippin – 0,05 %</b>                                    |                   |                   |
| 56 370 Aboitiz Equity Ventures Inc                                | 50 185            | 0,00              |
| 574 480 ACEN Corp   | 64 671            | 0,00              |
| 10 360 Ayala Corp   | 123 866           | 0,01              |
| 165 700 Ayala Land Inc  | 80 770            | 0,00              |
| 45 204 BDO Unibank Inc  | 106 846           | 0,01              |
| 34 650 International Container Terminal Services Inc              | 136 012           | 0,01              |
| 71 316 JG Summit Holdings Inc                                     | 62 835            | 0,00              |
| 18 870 Jollibee Foods Corp  | 77 750            | 0,00              |
| 760 Manila Electric Co  | 4 348             | 0,00              |
| 66 850 Metropolitan Bank & Trust Co                               | 71 935            | 0,00              |
| 559 800 Monde Nissin Corp   | 101 014           | 0,00              |
| 815 PLDT Inc  | 21 288            | 0,00              |
| 6 650 SM Investments Corp   | 108 744           | 0,01              |
| 573 200 SM Prime Holdings Inc                                     | 345 828           | 0,01              |
| 18 790 Universal Robina Corp                                      | 49 770            | 0,00              |
|   | <b>1 405 862</b>  | <b>0,05</b>       |
| <b>Zloty polonais – 0,06 %</b>                                    |                   |                   |
| 8 258 Bank Pekao  | 163 816           | 0,01              |
| 4 801 CD Projekt SA   | 123 946           | 0,00              |
| 7 783 Cyfrowy Polsat SA   | 30 243            | 0,00              |
| 3 332 Dino Polska SA  | 302 491           | 0,01              |
| 2 586 KGHM Polska Miedz SA  | 73 383            | 0,00              |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Zloty polonais – 0,06 % (suite)</b>                            |                  |                   |
| 95 LPP SA   | 211 256          | 0,01              |
| 910 mBank SA  | 64 722           | 0,00              |
| 23 893 PGE Polska Grupa Energetyczna SA                           | 34 808           | 0,00              |
| 16 080 Polski Koncern Naftowy ORLEN SA                            | 217 384          | 0,01              |
| 33 137 Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA                | 219 372          | 0,01              |
| 15 105 Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA                           | 122 998          | 0,00              |
| 2 011 Santander Bank Polska SA                                    | 136 212          | 0,01              |
|   | <b>1 700 631</b> | <b>0,06</b>       |
| <b>Livre sterling – 3,77 %</b>                                    |                  |                   |
| 54 424 3i Group PLC   | 1 133 880        | 0,04              |
| 95 988 abrdrn PLC   | 241 523          | 0,01              |
| 5 422 Admiral Group PLC   | 136 628          | 0,00              |
| 48 175 Anglo American PLC   | 1 595 177        | 0,06              |
| 16 219 Antofagasta  | 317 053          | 0,01              |
| 22 730 Ashtead Group  | 1 393 422        | 0,05              |
| 16 563 Associated British Foods PLC                               | 397 299          | 0,01              |
| 67 032 AstraZeneca PLC  | 9 309 275        | 0,35              |
| 32 946 Auto Trader Group PLC                                      | 251 016          | 0,01              |
| 126 998 Aviva PLC   | 634 702          | 0,02              |
| 151 874 BAE Systems PLC   | 1 845 172        | 0,07              |
| 724 648 Barclays PLC  | 1 306 355        | 0,05              |
| 33 446 Barratt Developments PLC                                   | 192 918          | 0,01              |
| 3 357 Berkeley Group Holdings PLC                                 | 174 207          | 0,01              |
| 883 241 BP PLC  | 5 578 362        | 0,21              |
| 96 021 British American Tobacco PLC                               | 3 372 388        | 0,13              |
| 507 803 BT Group PLC  | 915 439          | 0,03              |
| 9 329 Bunzl PLC   | 352 620          | 0,01              |
| 14 423 Burberry Group PLC   | 461 170          | 0,02              |
| 5 117 Coca-Cola HBC AG  | 140 015          | 0,01              |
| 82 839 Compass Group PLC  | 2 082 326        | 0,08              |
| 6 610 Croda International PLC                                     | 531 077          | 0,02              |
| 3 165 DCC PLC   | 184 632          | 0,01              |
| 106 910 Diageo PLC  | 4 777 306        | 0,18              |
| 28 478 Entain PLC   | 442 434          | 0,02              |
| 43 603 Experian PLC   | 1 434 084        | 0,05              |
| 424 883 Glencore PLC  | 2 440 760        | 0,09              |
| 177 714 GSK PLC   | 3 140 006        | 0,12              |
| 242 473 Haleon PLC  | 965 374          | 0,04              |
| 20 912 Halma PLC  | 576 345          | 0,02              |
| 15 663 Hargreaves Lansdown PLC                                    | 154 816          | 0,01              |
| 10 021 Hikma Pharmaceuticals PLC                                  | 207 540          | 0,01              |
| 853 127 HSBC Holdings PLC   | 5 798 504        | 0,22              |
| 38 394 Imperial Brands PLC  | 884 883          | 0,03              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Livre sterling – 3,77 % (suite)</b>                            |                  |                   |
| 70 882 Informa PLC  | 607 009          | 0,02              |
| 9 084 InterContinental Hotels Group PLC                           | 596 639          | 0,02              |
| 7 775 Intertek Group PLC  | 389 631          | 0,01              |
| 61 203 J Sainsbury PLC  | 210 905          | 0,01              |
| 187 925 JD Sports Fashion PLC                                     | 413 020          | 0,02              |
| 6 805 Johnson Matthey PLC   | 166 892          | 0,01              |
| 81 094 Kingfisher PLC   | 261 902          | 0,01              |
| 264 552 Legal & General Group PLC                                 | 781 455          | 0,03              |
| 3 203 150 Lloyds Banking Group PLC                                | 1 888 185        | 0,07              |
| 13 418 London Stock Exchange Group PLC                            | 1 305 355        | 0,05              |
| 79 359 M&G PLC  | 194 284          | 0,01              |
| 153 214 Melrose Industries PLC                                    | 315 420          | 0,01              |
| 22 419 Mondi PLC  | 355 370          | 0,01              |
| 173 150 National Grid PLC   | 2 347 511        | 0,09              |
| 153 782 NatWest Group PLC   | 501 219          | 0,02              |
| 7 345 Next PLC  | 596 851          | 0,02              |
| 31 353 Ocado Group PLC  | 207 400          | 0,01              |
| 28 459 Pearson PLC  | 297 129          | 0,01              |
| 18 345 Persimmon PLC  | 284 894          | 0,01              |
| 36 947 Phoenix Group Holdings PLC                                 | 249 613          | 0,01              |
| 110 946 Prudential PLC  | 1 511 715        | 0,06              |
| 29 083 Reckitt Benckiser Group PLC                                | 2 214 397        | 0,08              |
| 88 956 RELX PLC   | 2 879 529        | 0,11              |
| 95 571 Rentokil Initial PLC                                       | 699 086          | 0,03              |
| 49 884 Rio Tinto PLC  | 3 378 780        | 0,13              |
| 416 892 Rolls-Royce Holdings PLC                                  | 768 148          | 0,03              |
| 46 791 Sage Group PLC   | 448 374          | 0,02              |
| 25 400 Schroders PLC  | 144 467          | 0,01              |
| 7 241 Severn Trent PLC  | 257 761          | 0,01              |
| 316 831 Shell PLC   | 9 043 450        | 0,34              |
| 48 960 Smith & Nephew PLC   | 679 221          | 0,03              |
| 12 828 Smiths Group PLC   | 272 257          | 0,01              |
| 2 227 Spirax-Sarco Engineering PLC                                | 326 436          | 0,01              |
| 59 702 SSE PLC  | 1 330 948        | 0,05              |
| 18 206 St James's Place PLC                                       | 272 606          | 0,01              |
| 160 266 Standard Chartered PLC                                    | 1 217 104        | 0,05              |
| 145 432 Taylor Wimpey PLC   | 213 895          | 0,01              |
| 267 862 Tesco PLC   | 879 993          | 0,03              |
| 108 726 Unilever PLC  | 5 632 796        | 0,21              |
| 21 538 United Utilities Group PLC                                 | 282 285          | 0,01              |
| 1 127 268 Vodafone Group PLC                                      | 1 244 673        | 0,05              |
| 7 716 Whitbread PLC   | 284 973          | 0,01              |



## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Livre sterling – 3,77 % (suite)</b>                            |                   |                   |
| 15 871 WPP PLC  | 188 113           | 0,01              |
|   | <b>99 510 399</b> | <b>3,77</b>       |
| <b>Riyal qatari – 0,07 %</b>                                      |                   |                   |
| 222 340 Commercial Bank PSQC                                      | 354 522           | 0,02              |
| 35 120 Industries Qatar QSC                                       | 125 429           | 0,01              |
| 81 370 Masraf Al Rayan QSC  | 66 057            | 0,00              |
| 111 550 Mesaieed Petrochemical Holding Co                         | 58 840            | 0,00              |
| 13 290 Qatar Electricity & Water Co QSC                           | 61 594            | 0,00              |
| 9 400 Qatar Fuel QSC  | 44 805            | 0,00              |
| 68 844 Qatar Islamic Bank SAQ                                     | 336 276           | 0,01              |
| 162 720 Qatar National Bank QPSC                                  | 718 382           | 0,03              |
|   | <b>1 765 905</b>  | <b>0,07</b>       |
| <b>Riyal saoudien – 0,42 %</b>                                    |                   |                   |
| 6 225 ACWA Power Co   | 233 166           | 0,01              |
| 101 973 Al Rajhi Bank   | 1 996 701         | 0,08              |
| 54 629 Alinma Bank  | 428 597           | 0,02              |
| 8 891 Almarai Co JSC  | 133 589           | 0,01              |
| 21 049 Arab National Bank   | 144 674           | 0,01              |
| 457 Arabian Internet & Communications Services Co                 | 30 290            | 0,00              |
| 19 654 Bank AlBilad   | 208 389           | 0,01              |
| 8 262 Bank Al-Jazira  | 40 015            | 0,00              |
| 22 110 Banque Saudi Fransi  | 213 225           | 0,01              |
| 2 670 Bupa Arabia for Cooperative Insurance Co                    | 123 624           | 0,00              |
| 35 951 Dar Al Arkan Real Estate Development Co                    | 153 431           | 0,01              |
| 1 623 Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co              | 125 994           | 0,00              |
| 527 Elm Co  | 62 026            | 0,00              |
| 112 346 Emaar Economic City                                       | 241 231           | 0,01              |
| 31 360 Etihad Etisalat Co   | 344 620           | 0,01              |
| 1 531 Jarir Marketing Co  | 66 482            | 0,00              |
| 69 309 Mobile Telecommunications Co Saudi Arabia                  | 240 034           | 0,01              |
| 564 Mouwasat Medical Services Co                                  | 35 309            | 0,00              |
| 633 Nahdi Medical Co  | 31 130            | 0,00              |
| 69 085 Rabigh Refining & Petrochemical Co                         | 185 517           | 0,01              |
| 53 177 Riyadh Bank  | 420 747           | 0,02              |
| 16 060 SABIC Agri-Nutrients Co                                    | 545 074           | 0,02              |
| 12 779 Sahara International Petrochemical Co                      | 128 856           | 0,00              |
| 38 739 Saudi Arabian Mining Co                                    | 660 494           | 0,03              |
| 96 944 Saudi Arabian Oil Co                                       | 834 188           | 0,03              |
| 36 686 Saudi Basic Industries Corp                                | 882 528           | 0,03              |
| 34 156 Saudi British Bank   | 320 750           | 0,01              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Riyal saoudien – 0,42 % (suite)</b>                            |                   |                   |
| 29 636 Saudi Electricity Co                                       | 184 430           | 0,01              |
| 13 434 Saudi Investment Bank                                      | 59 266            | 0,00              |
| 26 140 Saudi Kayan Petrochemical Co                               | 84 262            | 0,00              |
| 85 990 Saudi National Bank  | 1 050 335         | 0,04              |
| 751 Saudi Research & Media Group                                  | 39 454            | 0,00              |
| 929 Saudi Tadawul Group Holding Co                                | 35 737            | 0,00              |
| 48 703 Saudi Telecom Co   | 519 635           | 0,02              |
| 10 349 Savola Group   | 77 058            | 0,00              |
| 23 178 Yanbu National Petrochemical Co                            | 260 264           | 0,01              |
|   | <b>11 141 122</b> | <b>0,42</b>       |
| <b>Dollar de Singapour – 0,32 %</b>                               |                   |                   |
| 244 043 Capitaland Investment Ltd/Singapore                       | 675 475           | 0,02              |
| 20 900 City Developments Ltd                                      | 115 854           | 0,00              |
| 81 266 DBS Group Holdings Ltd                                     | 2 017 057         | 0,08              |
| 219 600 Genting Singapore Ltd                                     | 184 989           | 0,01              |
| 136 400 Keppel Corp Ltd   | 577 588           | 0,02              |
| 146 298 Oversea-Chinese Banking Corp Ltd                          | 1 361 142         | 0,05              |
| 2 700 532 Sembcorp Marine Ltd                                     | 241 708           | 0,01              |
| 63 250 Singapore Airlines Ltd                                     | 272 590           | 0,01              |
| 34 800 Singapore Exchange Ltd                                     | 246 038           | 0,01              |
| 75 600 Singapore Technologies Engineering Ltd                     | 208 113           | 0,01              |
| 355 600 Singapore Telecommunications Ltd                          | 657 949           | 0,02              |
| 60 513 United Overseas Bank Ltd                                   | 1 354 494         | 0,05              |
| 29 000 UOL Group  | 151 156           | 0,01              |
| 11 500 Venture Corp Ltd   | 152 837           | 0,01              |
| 115 600 Wilmar International Ltd                                  | 366 046           | 0,01              |
|   | <b>8 583 036</b>  | <b>0,32</b>       |
| <b>Rand sud-africain – 0,37 %</b>                                 |                   |                   |
| 37 600 Absa Group Ltd   | 385 229           | 0,01              |
| 2 166 Anglo American Platinum Ltd                                 | 116 464           | 0,00              |
| 21 613 AngloGold Ashanti Ltd                                      | 525 509           | 0,02              |
| 10 138 Aspen Pharmacare Holdings Ltd                              | 104 668           | 0,00              |
| 17 522 Bid Corp Ltd   | 393 548           | 0,02              |
| 17 838 Bidvest Group Ltd  | 254 784           | 0,01              |
| 2 944 Capitec Bank Holdings Ltd                                   | 280 037           | 0,01              |
| 3 763 Clicks Group Ltd  | 54 535            | 0,00              |
| 3 542 Discovery Ltd   | 27 839            | 0,00              |
| 11 836 Exxaro Resources Ltd                                       | 124 447           | 0,01              |
| 326 958 FirstRand Ltd   | 1 112 680         | 0,04              |
| 72 587 Gold Fields Ltd  | 969 599           | 0,04              |
| 51 106 Harmony Gold Mining Co Ltd                                 | 210 790           | 0,01              |
| 29 117 Impala Platinum Holdings Ltd                               | 268 859           | 0,01              |
| 3 130 Kumba Iron Ore Ltd  | 79 331            | 0,00              |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Rand sud-africain – 0,37 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 13 427 Mr Price Group Ltd   | 109 126          | 0,00              |
| 70 665 MTN Group Ltd  | 507 689          | 0,02              |
| 14 297 MultiChoice Group  | 99 404           | 0,00              |
| 8 502 Naspers Ltd   | 1 577 948        | 0,06              |
| 11 520 Nedbank Group Ltd  | 140 798          | 0,01              |
| 20 294 NEPI Rockcastle NV   | 118 167          | 0,00              |
| 9 675 Northam Platinum Holdings Ltd                               | 78 938           | 0,00              |
| 209 986 Old Mutual Ltd  | 139 655          | 0,01              |
| 6 986 Reinet Investments SCA                                      | 143 740          | 0,01              |
| 24 148 Remgro Ltd   | 182 963          | 0,01              |
| 138 294 Sanlam Ltd  | 439 376          | 0,02              |
| 20 759 Sasol Ltd  | 280 804          | 0,01              |
| 12 518 Shoprite Holdings Ltd                                      | 156 813          | 0,01              |
| 124 381 Sibanye Stillwater Ltd                                    | 256 789          | 0,01              |
| 40 473 Standard Bank Group Ltd                                    | 394 203          | 0,02              |
| 15 887 Vodacom Group Ltd  | 109 277          | 0,00              |
| 15 042 Woolworths Holdings Ltd/South Africa                       | 54 200           | 0,00              |
|   | <b>9 698 209</b> | <b>0,37</b>       |
| <b>Won sud-coréen – 1,21 %</b>                                    |                  |                   |
| 478 Amorepacific Corp   | 50 229           | 0,00              |
| 335 BGF retail Co Ltd   | 46 756           | 0,00              |
| 2 550 Celltrion Healthcare Co Ltd                                 | 117 917          | 0,01              |
| 5 399 Celltrion Inc   | 621 247          | 0,02              |
| 956 Celltrion Pharm Inc   | 60 877           | 0,00              |
| 6 612 Cheil Worldwide Inc   | 94 570           | 0,00              |
| 244 CJ CheilJedang Corp   | 61 101           | 0,00              |
| 627 CJ Corp   | 50 233           | 0,00              |
| 2 383 Coway Co Ltd  | 96 100           | 0,00              |
| 641 DB Insurance Co Ltd   | 36 879           | 0,00              |
| 2 400 Doosan Bobcat Inc   | 80 562           | 0,00              |
| 19 194 Doosan Enerbility Co Ltd                                   | 250 642          | 0,01              |
| 1 796 Ecopro BM Co Ltd  | 309 715          | 0,01              |
| 411 E-MART Inc  | 33 338           | 0,00              |
| 12 475 Hana Financial Group Inc                                   | 390 008          | 0,02              |
| 760 Hankook Tire & Technology Co Ltd                              | 20 316           | 0,00              |
| 446 Hanmi Pharm Co Ltd  | 87 703           | 0,00              |
| 4 456 Hanon Systems   | 30 052           | 0,00              |
| 4 247 Hanwha Galleria Co Ltd                                      | 6 949            | 0,00              |
| 3 766 Hanwha Solutions Corp                                       | 155 344          | 0,01              |
| 1 855 HD Hyundai Co Ltd   | 82 786           | 0,00              |
| 3 726 HLB Inc   | 99 457           | 0,00              |
| 11 965 HMM Co Ltd   | 187 032          | 0,01              |
| 1 507 Hotel Shilla Co Ltd   | 94 343           | 0,00              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Won sud-coréen – 1,21 % (suite)</b>                            |                  |                   |
| 1 965 Hyundai Engineering & Construction Co Ltd                   | 55 017           | 0,00              |
| 1 328 Hyundai Glovis Co Ltd                                       | 161 684          | 0,01              |
| 4 274 Hyundai Mobis Co Ltd  | 709 132          | 0,03              |
| 9 210 Hyundai Motor Co  | 1 305 254        | 0,05              |
| 3 077 Hyundai Steel Co  | 82 015           | 0,00              |
| 4 531 Industrial Bank of Korea                                    | 35 152           | 0,00              |
| 14 676 Kakao  | 688 792          | 0,03              |
| 1 255 Kakao Games Corp  | 40 199           | 0,00              |
| 5 703 KakaoBank Corp  | 105 794          | 0,01              |
| 2 450 Kangwon Land Inc  | 37 451           | 0,00              |
| 8 496 KB Financial Group Inc                                      | 310 969          | 0,01              |
| 13 559 Kia Corp   | 843 629          | 0,03              |
| 3 400 Korea Aerospace Industries Ltd                              | 123 793          | 0,01              |
| 8 340 Korea Electric Power Corp                                   | 115 377          | 0,01              |
| 2 431 Korea Investment Holdings Co Ltd                            | 102 704          | 0,00              |
| 1 219 Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd            | 72 568           | 0,00              |
| 340 Korea Zinc Co Ltd   | 144 425          | 0,01              |
| 9 672 Korean Air Lines Co Ltd                                     | 172 363          | 0,01              |
| 1 037 Krafton Inc   | 146 169          | 0,01              |
| 4 908 KT&G Corp   | 316 305          | 0,01              |
| 1 210 Kumho Petrochemical Co Ltd                                  | 133 561          | 0,01              |
| 697 L&F Co Ltd  | 167 845          | 0,01              |
| 2 227 LG Chem Ltd   | 1 217 977        | 0,05              |
| 4 521 LG Corp   | 287 544          | 0,01              |
| 3 839 LG Display Co Ltd   | 48 450           | 0,00              |
| 4 440 LG Electronics Inc  | 393 234          | 0,02              |
| 1 078 LG Energy Solution Ltd                                      | 483 583          | 0,02              |
| 654 LG H&H Co Ltd   | 301 417          | 0,01              |
| 755 LG Innotek Co Ltd   | 156 875          | 0,01              |
| 10 249 LG Uplus Corp  | 85 261           | 0,00              |
| 702 Lotte Chemical Corp   | 102 886          | 0,01              |
| 454 Lotte Shopping Co Ltd   | 28 561           | 0,00              |
| 5 072 Mirae Asset Securities Co Ltd                               | 25 168           | 0,00              |
| 6 149 NAVER Corp  | 954 102          | 0,04              |
| 951 NCSOFT Corp   | 271 380          | 0,01              |
| 912 Netmarble Corp  | 46 446           | 0,00              |
| 4 320 NH Investment & Securities Co Ltd                           | 29 202           | 0,00              |
| 895 Orion Corp/Republic of Korea                                  | 93 910           | 0,00              |
| 16 540 Pan Ocean Co Ltd   | 73 816           | 0,00              |
| 2 577 Pearl Abyss Corp  | 91 551           | 0,00              |
| 1 299 POSCO Chemical Co Ltd                                       | 271 903          | 0,01              |
| 4 248 POSCO Holdings Inc  | 1 200 802        | 0,05              |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                   |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                   |                   | <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Won sud-coréen – 1,21 % (suite)</b>                            |                   |                   | <b>Couronne suédoise – 0,83 % (suite)</b>                         |                   |                   |
| 985 S-1 Corp  | 41 841            | 0,00              | 7 484 Industrivarden AB (Class C)                                 | 201 507           | 0,01              |
| 929 Samsung Biologics Co Ltd                                      | 562 317           | 0,02              | 3 775 Industrade AB   | 80 127            | 0,00              |
| 3 412 Samsung C&T Corp  | 283 580           | 0,01              | 7 341 Investment AB Latour  | 149 092           | 0,01              |
| 1 532 Samsung Electro-Mechanics Co Ltd                            | 179 695           | 0,01              | 17 339 Investor AB (Class A)                                      | 353 149           | 0,01              |
| 209 063 Samsung Electronics Co Ltd (Voting rights)                | 10 277 706        | 0,39              | 70 082 Investor AB (Class B)                                      | 1 392 577         | 0,05              |
| 2 902 Samsung Engineering Co Ltd                                  | 70 664            | 0,00              | 13 179 Kinnevik AB  | 196 359           | 0,01              |
| 923 Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd                        | 146 052           | 0,01              | 1 225 L E Lundbergforetagen AB                                    | 55 370            | 0,00              |
| 12 052 Samsung Heavy Industries Co Ltd                            | 47 862            | 0,00              | 11 175 Lifco AB   | 240 321           | 0,01              |
| 1 747 Samsung Life Insurance Co Ltd                               | 84 274            | 0,00              | 57 207 Nibe Industrier AB   | 649 882           | 0,02              |
| 2 541 Samsung SDI Co Ltd  | 1 434 601         | 0,06              | 137 370 Nordea Bank Abp   | 1 465 697         | 0,06              |
| 1 061 Samsung SDS Co Ltd  | 94 539            | 0,00              | 51 414 Sandvik AB   | 1 089 806         | 0,04              |
| 2 660 Samsung Securities Co Ltd                                   | 64 771            | 0,00              | 12 422 Securitas AB   | 110 545           | 0,00              |
| 30 966 Shinhan Financial Group Co Ltd                             | 840 840           | 0,03              | 74 293 Skandinaviska Enskilda Banken AB                           | 819 264           | 0,03              |
| 859 SK Bioscience Co Ltd  | 47 574            | 0,00              | 11 384 Skanska AB   | 174 061           | 0,01              |
| 24 983 SK Hynix Inc   | 1 700 268         | 0,07              | 11 454 SKF AB   | 225 334           | 0,01              |
| 1 776 SK Inc  | 235 327           | 0,01              | 27 119 Svenska Cellulosa AB SCA                                   | 356 851           | 0,01              |
| 2 214 SK Innovation Co Ltd  | 304 928           | 0,01              | 85 391 Svenska Handelsbanken AB                                   | 739 813           | 0,03              |
| 997 SK Square Co Ltd  | 30 442            | 0,00              | 50 272 Swedbank AB  | 824 894           | 0,03              |
| 998 SKC Co Ltd  | 87 623            | 0,00              | 4 245 Swedish Orphan Biovitrum AB                                 | 98 863            | 0,00              |
| 1 526 S-Oil Corp  | 93 891            | 0,00              | 16 454 Tele2 AB   | 163 833           | 0,01              |
| 24 415 Woori Financial Group Inc                                  | 213 984           | 0,01              | 133 781 Telefonaktiebolaget LM Ericsson                           | 781 821           | 0,03              |
| 1 533 Yuhan   | 59 584            | 0,00              | 120 276 Telia Co AB   | 305 865           | 0,01              |
|   | <b>32 000 785</b> | <b>1,21</b>       | 9 929 Volvo AB (Class A)  | 213 526           | 0,01              |
|   |                   |                   | 62 682 Volvo AB (Class B)   | 1 292 683         | 0,05              |
|   |                   |                   | 23 773 Volvo Car AB   | 103 613           | 0,00              |
|   |                   |                   |   | <b>21 966 795</b> | <b>0,83</b>       |
| <b>Couronne suédoise – 0,83 %</b>                                 |                   |                   | <b>Franc suisse – 2,52 %</b>                                      |                   |                   |
| 9 600 Alfa Laval AB   | 342 264           | 0,01              | 68 113 ABB Ltd  | 2 338 903         | 0,09              |
| 40 517 Assa Abloy AB  | 970 184           | 0,04              | 5 893 Adecco Group AG   | 213 839           | 0,01              |
| 123 412 Atlas Copco AB (Class A)                                  | 1 565 508         | 0,06              | 20 149 Alcon Inc  | 1 427 005         | 0,05              |
| 55 656 Atlas Copco AB (Class B)                                   | 639 669           | 0,02              | 559 Bachem Holding AG   | 55 928            | 0,00              |
| 14 744 Boliden AB   | 579 833           | 0,02              | 3 609 Baloise Holding AG  | 562 554           | 0,02              |
| 9 311 Electrolux AB   | 113 066           | 0,00              | 64 Barry Callebaut AG   | 135 839           | 0,01              |
| 48 046 Embracer Group AB  | 224 580           | 0,01              | 21 Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG (Non voting rights)     | 248 262           | 0,01              |
| 37 401 Epiroc AB (Class A)  | 742 281           | 0,03              | 4 Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG (Voting rights)          | 472 881           | 0,02              |
| 16 764 Epiroc AB (Class B)  | 285 259           | 0,01              | 24 048 Cie Financiere Richemont SA                                | 3 840 625         | 0,15              |
| 11 437 EQT AB   | 232 279           | 0,01              | 6 265 Clariant AG   | 103 622           | 0,00              |
| 23 973 Essity AB  | 685 237           | 0,03              | 141 390 Credit Suisse Group AG                                    | 127 314           | 0,00              |
| 8 422 Evolution AB  | 1 127 476         | 0,04              | 252 EMS-Chemie Holding AG   | 207 989           | 0,01              |
| 59 088 Fastighets AB Balder                                       | 242 231           | 0,01              | 1 920 Geberit AG  | 1 070 181         | 0,04              |
| 10 965 Getinge AB   | 267 211           | 0,01              | 413 Givaudan SA   | 1 344 041         | 0,05              |
| 47 717 H & M Hennes & Mauritz AB                                  | 680 215           | 0,03              | 21 128 Holcim AG  | 1 362 202         | 0,05              |
| 76 557 Hexagon AB   | 877 454           | 0,03              |   |                   |                   |
| 14 791 Husqvarna AB   | 128 147           | 0,01              |   |                   |                   |
| 6 638 Industrivarden AB (Class A)                                 | 179 048           | 0,01              |   |                   |                   |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Franc suisse – 2,52 % (suite)</b>                              |                   |                   |
| 13 860 Julius Baer Group Ltd                                      | 945 493           | 0,04              |
| 2 331 Kuehne + Nagel International AG                             | 693 776           | 0,03              |
| 10 582 Logitech International SA                                  | 615 078           | 0,02              |
| 3 332 Lonza Group AG  | 1 996 537         | 0,08              |
| 120 175 Nestle SA   | 14 662 258        | 0,56              |
| 92 134 Novartis AG  | 8 447 424         | 0,32              |
| 693 Partners Group Holding AG                                     | 649 951           | 0,02              |
| 30 553 Roche Holding AG (Non voting rights)                       | 8 727 279         | 0,33              |
| 840 Roche Holding AG (Voting rights)                              | 252 860           | 0,01              |
| 2 176 Schindler Holding AG (Non voting rights)                    | 481 385           | 0,02              |
| 324 Schindler Holding AG (Voting rights)                          | 68 449            | 0,00              |
| 396 SGS SA  | 871 716           | 0,03              |
| 6 666 Sika AG   | 1 864 335         | 0,07              |
| 3 420 Sonova Holding AG   | 1 005 541         | 0,04              |
| 3 410 Straumann Holding AG  | 508 952           | 0,02              |
| 1 462 Swatch Group AG (BR)  | 501 550           | 0,02              |
| 5 078 Swatch Group AG (REGD)                                      | 321 283           | 0,01              |
| 1 045 Swiss Life Holding AG                                       | 644 238           | 0,02              |
| 1 696 Swiss Prime Site AG   | 141 186           | 0,01              |
| 13 057 Swiss Re AG  | 1 341 217         | 0,05              |
| 1 190 Swisscom AG   | 759 683           | 0,03              |
| 2 819 Temenos AG  | 195 267           | 0,01              |
| 167 406 UBS Group AG  | 3 534 849         | 0,13              |
| 1 325 VAT Group AG  | 476 017           | 0,02              |
| 6 530 Zurich Insurance Group AG                                   | 3 128 653         | 0,12              |
|   | <b>66 346 162</b> | <b>2,52</b>       |
| <b>Baht thaïlandais – 0,03 %</b>                                  |                   |                   |
| 113 100 Airports of Thailand PCL                                  | 234 832           | 0,01              |
| 83 125 Minor International PCL                                    | 78 397            | 0,00              |
| 455 500 PTT PCL   | 419 601           | 0,02              |
| 169 050 True Corp PCL   | 41 527            | 0,00              |
|   | <b>774 357</b>    | <b>0,03</b>       |
| <b>Lire turque – 0,05 %</b>                                       |                   |                   |
| 116 223 Akbank TAS  | 102 569           | 0,01              |
| 86 646 Aselsan Elektronik Sanayi Ve Ticaret AS                    | 234 502           | 0,01              |
| 8 998 BIM Birlesik Magazalar AS                                   | 69 706            | 0,00              |
| 44 415 Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS                      | 81 912            | 0,00              |
| 5 867 Ford Otomotiv Sanayi AS                                     | 178 776           | 0,01              |
| 27 539 KOC Holding AS   | 109 754           | 0,01              |
| 13 294 Turk Hava Yollari AO                                       | 82 070            | 0,00              |
| 43 187 Turkcell Iletisim Hizmetleri AS                            | 71 952            | 0,00              |
| 133 312 Turkiye Is Bankasi AS                                     | 90 079            | 0,00              |
| 12 938 Turkiye Petrol Rafinerileri AS                             | 357 303           | 0,01              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Livre turque – 0,05 % (suite)</b>                              |                  |                   |
| 14 151 Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS                         | 31 199           | 0,00              |
| 61 225 Yapi ve Kredi Bankasi AS                                   | 30 525           | 0,00              |
|   | <b>1 440 347</b> | <b>0,05</b>       |
| <b>Dirham des Émirats arabes unis – 0,15 %</b>                    |                  |                   |
| 161 000 Abu Dhabi Commercial Bank PJSC                            | 363 867          | 0,01              |
| 162 454 Abu Dhabi Islamic Bank PJSC                               | 441 468          | 0,02              |
| 353 620 Aldar Properties PJSC                                     | 447 742          | 0,02              |
| 36 917 Dubai Islamic Bank PJSC                                    | 52 573           | 0,00              |
| 137 844 Emaar Properties PJSC                                     | 210 191          | 0,01              |
| 121 911 Emirates NBD Bank PJSC                                    | 436 523          | 0,02              |
| 187 356 Emirates Telecommunications Group Co PJSC                 | 1 125 411        | 0,04              |
| 199 715 First Abu Dhabi Bank PJSC                                 | 700 430          | 0,03              |
| 69 264 Multiply Group PJSC  | 61 107           | 0,00              |
|   | <b>3 839 312</b> | <b>0,15</b>       |
| <b>Dollar américain – 59,06 %</b>                                 |                  |                   |
| 24 996 3M Co  | 2 627 330        | 0,10              |
| 3 800 A O Smith Corp  | 262 770          | 0,01              |
| 74 741 Abbott Laboratories  | 7 568 274        | 0,29              |
| 77 273 AbbVie Inc   | 12 314 998       | 0,47              |
| 26 637 Accenture PLC  | 7 613 121        | 0,29              |
| 33 561 Activision Blizzard Inc                                    | 2 872 486        | 0,11              |
| 20 010 Adobe Inc  | 7 711 254        | 0,29              |
| 3 349 Advance Auto Parts Inc                                      | 407 272          | 0,02              |
| 68 855 Advanced Micro Devices                                     | 6 748 479        | 0,26              |
| 5 800 AECOM   | 489 056          | 0,02              |
| 6 500 AerCap Holdings NV  | 365 495          | 0,01              |
| 31 803 AES Corp   | 765 816          | 0,03              |
| 27 779 Aflac Inc  | 1 792 301        | 0,07              |
| 14 657 Agilent Technologies Inc                                   | 2 027 649        | 0,08              |
| 9 511 Air Products and Chemicals Inc                              | 2 731 654        | 0,10              |
| 14 697 Airbnb Inc   | 1 828 307        | 0,07              |
| 9 660 Akamai Technologies Inc                                     | 756 378          | 0,03              |
| 4 587 Albemarle   | 1 013 910        | 0,04              |
| 4 300 Alcoa Corp  | 183 008          | 0,01              |
| 3 447 Align Technology Inc  | 1 151 781        | 0,04              |
| 2 900 Allegion PLC  | 309 517          | 0,01              |
| 10 813 Alliant Energy Corp  | 577 414          | 0,02              |
| 14 384 Allstate   | 1 593 891        | 0,06              |
| 13 578 Ally Financial Inc   | 346 103          | 0,01              |
| 6 710 Alnylam Pharmaceuticals Inc                                 | 1 344 147        | 0,05              |
| 259 667 Alphabet Inc (Class A)                                    | 26 935 258       | 1,02              |
| 238 918 Alphabet Inc (Class C)                                    | 24 847 472       | 0,94              |
| 77 973 Altria Group Inc   | 3 479 155        | 0,13              |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 59,06 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 59,06 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 400 010 Amazon.com Inc  | 41 317 033       | 1,57              | 6 000 Bath & Body Works Inc                                       | 219 480          | 0,01              |
| 83 541 Amcor PLC  | 950 697          | 0,04              | 19 479 Baxter International Inc                                   | 790 068          | 0,03              |
| 13 675 Ameren Corp  | 1 181 383        | 0,04              | 11 482 Becton Dickinson and Co                                    | 2 842 254        | 0,11              |
| 21 314 American Electric Power Co Inc                             | 1 939 361        | 0,07              | 8 400 Bentley Systems Inc   | 361 116          | 0,01              |
| 30 162 American Express   | 4 975 222        | 0,19              | 56 612 Berkshire Hathaway Inc                                     | 17 480 087       | 0,66              |
| 2 300 American Financial Group                                    | 279 450          | 0,01              | 12 073 Best Buy Co Inc  | 944 954          | 0,04              |
| 36 739 American International Group Inc                           | 1 850 176        | 0,07              | 4 300 BILL Holdings Inc   | 348 902          | 0,01              |
| 7 808 American Water Works Co Inc                                 | 1 143 794        | 0,04              | 6 541 Biogen Inc  | 1 818 594        | 0,07              |
| 3 597 Ameriprise Financial Inc                                    | 1 102 480        | 0,04              | 9 838 BioMarin Pharmaceutical                                     | 956 647          | 0,04              |
| 8 289 AmerisourceBergen Corp                                      | 1 327 152        | 0,05              | 800 Bio-Rad Laboratories Inc                                      | 383 216          | 0,01              |
| 10 834 AMETEK   | 1 574 505        | 0,06              | 3 900 Bio-Techne Corp   | 289 341          | 0,01              |
| 23 243 Amgen Inc  | 5 618 995        | 0,21              | 4 500 Black Knight Inc  | 259 020          | 0,01              |
| 27 583 Amphenol Corp  | 2 254 083        | 0,09              | 6 362 BlackRock Inc   | 4 256 941        | 0,16              |
| 20 597 Analog Devices   | 4 062 140        | 0,15              | 28 776 Blackstone Inc   | 2 527 684        | 0,10              |
| 4 086 ANSYS Inc   | 1 359 821        | 0,05              | 22 511 Block Inc  | 1 545 380        | 0,06              |
| 8 273 Aon PLC   | 2 608 394        | 0,10              | 23 850 Boeing Co  | 5 066 455        | 0,19              |
| 10 100 APA Corp   | 364 206          | 0,01              | 1 799 Booking Holdings Inc  | 4 771 686        | 0,18              |
| 14 855 Apollo Global Management Inc                               | 938 242          | 0,04              | 3 100 Booz Allen Hamilton Holding Corp                            | 287 339          | 0,01              |
| 700 351 Apple Inc   | 115 487 880      | 4,38              | 7 718 BorgWarner Inc  | 379 031          | 0,01              |
| 37 097 Applied Materials  | 4 556 624        | 0,17              | 57 717 Boston Scientific Corp                                     | 2 887 581        | 0,11              |
| 12 056 Aptiv PLC  | 1 352 563        | 0,05              | 95 873 Bristol-Myers Squibb Co                                    | 6 644 958        | 0,25              |
| 7 292 Aramark   | 261 054          | 0,01              | 18 268 Broadcom Inc   | 11 719 653       | 0,44              |
| 18 193 Arch Capital Group Ltd                                     | 1 234 759        | 0,05              | 7 156 Broadridge Financial Solutions Inc                          | 1 048 855        | 0,04              |
| 22 992 Archer-Daniels-Midland Co                                  | 1 831 543        | 0,07              | 7 137 Brown & Brown   | 409 807          | 0,02              |
| 6 600 Ares Management Corp  | 550 704          | 0,02              | 16 325 Brown-Forman   | 1 049 208        | 0,04              |
| 10 984 Arista Networks Inc  | 1 843 774        | 0,07              | 5 337 Bunge Ltd   | 509 790          | 0,02              |
| 3 200 Arrow Electronics Inc                                       | 399 584          | 0,02              | 4 482 Burlington Stores Inc                                       | 905 812          | 0,03              |
| 8 783 Arthur J Gallagher & Co                                     | 1 680 276        | 0,06              | 13 154 Cadence Design Systems Inc                                 | 2 763 524        | 0,10              |
| 800 Aspen Technology Inc  | 183 096          | 0,01              | 5 900 Caesars Entertainment Inc                                   | 287 979          | 0,01              |
| 2 100 Assurant Inc  | 252 147          | 0,01              | 9 437 Campbell Soup Co  | 518 846          | 0,02              |
| 292 047 AT&T Inc  | 5 621 905        | 0,21              | 20 239 Capital One Financial Corp                                 | 1 946 182        | 0,07              |
| 6 600 Atlassian Corp  | 1 129 722        | 0,04              | 16 980 Cardinal Health Inc  | 1 281 990        | 0,05              |
| 5 638 Atmos Energy Corp   | 633 486          | 0,02              | 2 200 Carlisle Cos Inc  | 497 354          | 0,02              |
| 9 776 Autodesk Inc  | 2 034 972        | 0,08              | 7 700 Carlyle Group Inc   | 239 162          | 0,01              |
| 18 405 Automatic Data Processing                                  | 4 097 505        | 0,16              | 10 328 CarMax Inc   | 663 884          | 0,03              |
| 892 AutoZone  | 2 192 670        | 0,08              | 31 552 Carnival Corp  | 320 253          | 0,01              |
| 20 000 Avantor Inc  | 422 800          | 0,02              | 38 417 Carrier Global Corp  | 1 757 578        | 0,07              |
| 2 400 Avery Dennison Corp   | 429 432          | 0,02              | 6 583 Catalent Inc  | 432 569          | 0,02              |
| 3 000 Axon Enterprise Inc   | 674 550          | 0,03              | 22 672 Caterpillar Inc  | 5 188 260        | 0,20              |
| 34 274 Baker Hughes Co  | 989 148          | 0,04              | 5 493 Cboe Global Markets Inc                                     | 737 380          | 0,03              |
| 14 476 Ball Corp  | 797 772          | 0,03              | 15 533 CBRE Group Inc   | 1 130 958        | 0,04              |
| 316 763 Bank of America Corp                                      | 9 059 422        | 0,34              | 7 459 CDW Corp/DE   | 1 453 685        | 0,06              |
| 38 183 Bank of New York Mellon Corp                               | 1 735 036        | 0,07              | 6 845 Celanese Corp   | 745 352          | 0,03              |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 59,06 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 28 477 Centene Corp   | 1 800 031        | 0,07              |
| 22 317 CenterPoint Energy Inc                                     | 657 459          | 0,02              |
| 6 000 Ceridian HCM Holding Inc                                    | 439 320          | 0,02              |
| 8 117 CF Industries Holdings Inc                                  | 588 401          | 0,02              |
| 9 028 CH Robinson Worldwide Inc                                   | 897 112          | 0,03              |
| 2 300 Charles River Laboratories International Inc                | 464 186          | 0,02              |
| 60 944 Charles Schwab Corp  | 3 192 247        | 0,12              |
| 6 006 Charter Communications Inc                                  | 2 147 806        | 0,08              |
| 4 294 Check Point Software Technologies Ltd                       | 558 220          | 0,02              |
| 10 930 Cheniere Energy Inc  | 1 722 568        | 0,07              |
| 1 300 Chesapeake Energy Corp                                      | 98 852           | 0,00              |
| 83 849 Chevron Corp   | 13 680 803       | 0,52              |
| 2 200 Chewy Inc   | 82 236           | 0,00              |
| 1 193 Chipotle Mexican Grill Inc                                  | 2 037 990        | 0,08              |
| 19 150 Chubb Ltd  | 3 718 547        | 0,14              |
| 9 336 Church & Dwight Co Inc                                      | 825 396          | 0,03              |
| 12 524 Cigna Group  | 3 200 258        | 0,12              |
| 6 332 Cincinnati Financial  | 709 691          | 0,03              |
| 4 025 Cintas Corp   | 1 862 287        | 0,07              |
| 184 994 Cisco Systems Inc   | 9 670 561        | 0,37              |
| 81 353 Citigroup Inc  | 3 814 642        | 0,14              |
| 20 346 Citizens Financial Group Inc                               | 617 908          | 0,02              |
| 16 900 Clarivate PLC  | 158 691          | 0,01              |
| 12 600 Cleveland-Cliffs Inc                                       | 230 958          | 0,01              |
| 4 006 Clorox Co   | 633 909          | 0,02              |
| 10 997 Cloudflare Inc   | 678 075          | 0,03              |
| 15 374 CME Group Inc  | 2 944 428        | 0,11              |
| 17 009 CMS Energy Corp  | 1 044 012        | 0,04              |
| 174 058 Coca-Cola   | 10 796 818       | 0,41              |
| 7 875 Coca-Cola Europacific Partners PLC                          | 466 121          | 0,02              |
| 9 137 Cognex Corp   | 452 738          | 0,02              |
| 25 343 Cognizant Technology Solutions Corp                        | 1 544 149        | 0,06              |
| 5 200 Coinbase Global Inc   | 351 364          | 0,01              |
| 33 938 Colgate-Palmolive  | 2 550 441        | 0,10              |
| 192 463 Comcast Corp  | 7 296 272        | 0,28              |
| 27 798 Conagra Brands Inc   | 1 044 093        | 0,04              |
| 52 370 ConocoPhillips   | 5 195 628        | 0,20              |
| 12 662 Consolidated Edison Inc                                    | 1 211 374        | 0,05              |
| 7 451 Constellation Brands Inc                                    | 1 683 106        | 0,06              |
| 17 721 Constellation Energy Corp                                  | 1 391 098        | 0,05              |
| 2 798 Cooper Cos Inc  | 1 044 661        | 0,04              |
| 21 298 Copart   | 1 601 823        | 0,06              |
| 36 742 Corning Inc  | 1 296 258        | 0,05              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 59,06 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 32 681 Corteva Inc  | 1 970 991        | 0,07              |
| 16 115 CoStar Group Inc   | 1 109 518        | 0,04              |
| 18 611 Costco Wholesale Corp                                      | 9 247 248        | 0,35              |
| 37 302 Coterra Energy Inc   | 915 391          | 0,03              |
| 2 800 Credicorp Ltd   | 370 692          | 0,01              |
| 8 397 CrowdStrike Holdings Inc                                    | 1 152 572        | 0,04              |
| 4 200 Crown Holdings Inc  | 347 382          | 0,01              |
| 104 017 CSX Corp  | 3 114 269        | 0,12              |
| 6 928 Cummins Inc   | 1 654 961        | 0,06              |
| 55 874 CVS Health Corp  | 4 151 997        | 0,16              |
| 1 500 CyberArk Software Ltd                                       | 221 970          | 0,01              |
| 29 622 Danaher Corp   | 7 465 929        | 0,28              |
| 5 076 Darden Restaurants Inc                                      | 787 592          | 0,03              |
| 6 000 Darling Ingredients   | 350 400          | 0,01              |
| 10 497 Datadog Inc  | 762 712          | 0,03              |
| 4 554 DaVita Inc  | 369 375          | 0,01              |
| 12 809 Deere & Co   | 5 288 580        | 0,20              |
| 9 999 Dell Technologies Inc                                       | 402 060          | 0,02              |
| 1 748 Delta Air Lines Inc   | 61 040           | 0,00              |
| 10 900 DENTSPLY SIRONA Inc  | 428 152          | 0,02              |
| 24 800 Devon Energy Corp  | 1 255 128        | 0,05              |
| 18 512 Dexcom Inc   | 2 150 724        | 0,08              |
| 5 100 Diamondback Energy Inc                                      | 689 367          | 0,03              |
| 14 950 Discover Financial Services                                | 1 477 658        | 0,06              |
| 8 506 DISH Network Corp   | 79 361           | 0,00              |
| 8 443 DocuSign Inc  | 492 227          | 0,02              |
| 8 301 Dollar General Corp   | 1 747 028        | 0,07              |
| 11 286 Dollar Tree Inc  | 1 620 105        | 0,06              |
| 33 423 Dominion Energy Inc  | 1 868 680        | 0,07              |
| 2 429 Domino's Pizza Inc  | 801 254          | 0,03              |
| 8 300 DoorDash Inc  | 527 548          | 0,02              |
| 6 486 Dover Corp  | 985 483          | 0,04              |
| 30 035 Dow Inc  | 1 646 519        | 0,06              |
| 17 361 DR Horton  | 1 695 996        | 0,06              |
| 11 000 Dropbox Inc  | 237 820          | 0,01              |
| 8 808 DTE Energy Co   | 964 828          | 0,04              |
| 29 701 Duke Energy Corp   | 2 865 255        | 0,11              |
| 21 737 DuPont de Nemours Inc                                      | 1 560 064        | 0,06              |
| 7 800 Dynatrace Inc   | 329 940          | 0,01              |
| 8 182 Eastman Chemical Co   | 690 070          | 0,03              |
| 18 978 Eaton Corp PLC   | 3 251 691        | 0,12              |
| 19 553 eBay   | 867 567          | 0,03              |
| 10 663 Ecolab Inc   | 1 765 046        | 0,07              |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 59,06 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 59,06 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 13 550 Edison International                                       | 956 494          | 0,04              | 9 070 FMC   | 1 107 719        | 0,04              |
| 27 596 Edwards Lifesciences Corp                                  | 2 283 017        | 0,09              | 167 403 Ford Motor Co   | 2 109 278        | 0,08              |
| 17 082 Elanco Animal Health Inc                                   | 160 571          | 0,01              | 27 299 Fortinet Inc   | 1 814 292        | 0,07              |
| 13 652 Electronic Arts Inc  | 1 644 383        | 0,06              | 14 886 Fortive Corp   | 1 014 779        | 0,04              |
| 11 126 Elevance Health Inc  | 5 115 846        | 0,19              | 4 300 Fortune Brands Innovations Inc                              | 252 539          | 0,01              |
| 33 883 Eli Lilly & Co   | 11 636 100       | 0,44              | 12 017 Fox Corp (Class A)   | 409 179          | 0,02              |
| 27 655 Emerson Electric Co  | 2 409 857        | 0,09              | 16 894 Fox Corp (Class B)   | 528 951          | 0,02              |
| 5 800 Enphase Energy Inc  | 1 219 624        | 0,05              | 10 780 Franklin Resources Inc                                     | 290 413          | 0,01              |
| 6 500 Entegris Inc  | 533 065          | 0,02              | 66 378 Freeport-McMoRan Inc                                       | 2 715 524        | 0,10              |
| 9 467 Entergy Corp  | 1 019 975        | 0,04              | 9 983 Garmin Ltd  | 1 007 484        | 0,04              |
| 25 412 EOG Resources Inc  | 2 912 978        | 0,11              | 3 904 Gartner   | 1 271 806        | 0,05              |
| 2 700 EPAM Systems Inc  | 807 300          | 0,03              | 15 712 GE HealthCare Technologies Inc                             | 1 288 855        | 0,05              |
| 15 100 EQT Corp   | 481 841          | 0,02              | 26 925 Gen Digital Inc  | 462 033          | 0,02              |
| 5 807 Equifax Inc   | 1 177 892        | 0,04              | 2 800 Generac Holdings Inc  | 302 428          | 0,01              |
| 15 177 Equitable Holdings Inc                                     | 385 344          | 0,01              | 11 231 General Dynamics Corp                                      | 2 563 026        | 0,10              |
| 600 Erie Indemnity Co   | 138 996          | 0,01              | 47 442 General Electric Co  | 4 535 455        | 0,17              |
| 9 537 Essential Utilities Inc                                     | 416 290          | 0,02              | 23 660 General Mills Inc  | 2 021 984        | 0,08              |
| 9 925 Estee Lauder  | 2 446 115        | 0,09              | 55 231 General Motors Co  | 2 025 873        | 0,08              |
| 5 000 Etsy Inc  | 556 650          | 0,02              | 6 628 Genuine Parts Co  | 1 108 931        | 0,04              |
| 1 447 Everest Re Group  | 518 055          | 0,02              | 54 192 Gilead Sciences Inc  | 4 496 310        | 0,17              |
| 11 096 Evergy Inc   | 678 188          | 0,03              | 10 738 Global Payments Inc  | 1 130 067        | 0,04              |
| 11 515 Eversource Energy  | 901 164          | 0,03              | 3 000 Globe Life Inc  | 330 060          | 0,01              |
| 9 904 Exact Sciences Corp   | 671 590          | 0,03              | 8 277 GoDaddy Inc   | 643 288          | 0,02              |
| 41 879 Exelon Corp  | 1 754 311        | 0,07              | 14 389 Goldman Sachs Group Inc                                    | 4 706 786        | 0,18              |
| 6 364 Expedia Group Inc   | 617 499          | 0,02              | 68 400 Grab Holdings Ltd  | 205 884          | 0,01              |
| 9 300 Expeditors International of Washington                      | 1 024 116        | 0,04              | 7 400 Graco Inc   | 540 274          | 0,02              |
| 180 538 Exxon Mobil Corp  | 19 797 797       | 0,75              | 35 108 Halliburton Co   | 1 110 817        | 0,04              |
| 3 194 F5 Networks   | 465 334          | 0,02              | 18 073 Hartford Financial Services Group Inc                      | 1 259 507        | 0,05              |
| 900 FactSet Research Systems Inc                                  | 373 581          | 0,01              | 5 914 Hasbro Inc  | 317 523          | 0,01              |
| 1 000 Fair Isaac Corp   | 702 690          | 0,03              | 11 865 HCA Healthcare Inc   | 3 128 563        | 0,12              |
| 25 940 Fastenal Co  | 1 399 204        | 0,05              | 23 HEICO (Restricted voting rights)                               | 3 126            | 0,00              |
| 11 408 FedEx Corp   | 2 606 614        | 0,10              | 2 000 HEICO Corp (Voting rights)                                  | 342 080          | 0,01              |
| 11 161 Ferguson PLC   | 1 492 784        | 0,06              | 5 161 Henry Schein Inc  | 420 828          | 0,02              |
| 10 500 Fidelity National Financial Inc                            | 366 765          | 0,01              | 7 103 Hershey Co  | 1 807 074        | 0,07              |
| 28 534 Fidelity National Information Services Inc                 | 1 550 252        | 0,06              | 12 334 Hess Corp  | 1 632 282        | 0,06              |
| 35 453 Fifth Third Bancorp  | 944 468          | 0,04              | 69 464 Hewlett Packard Enterprise Co                              | 1 106 562        | 0,04              |
| 600 First Citizens BancShares Inc/NC                              | 583 860          | 0,02              | 2 900 HF Sinclair Corp  | 140 302          | 0,01              |
| 22 800 First Horizon Corp   | 405 384          | 0,02              | 12 599 Hilton Worldwide Holdings Inc                              | 1 774 821        | 0,07              |
| 7 888 First Republic Bank/CA                                      | 110 353          | 0,00              | 16 940 Hologic  | 1 367 058        | 0,05              |
| 4 100 First Solar Inc   | 891 750          | 0,03              | 43 054 Home Depot Inc   | 12 706 096       | 0,48              |
| 28 203 FirstEnergy Corp   | 1 129 812        | 0,04              | 30 488 Honeywell International Inc                                | 5 826 867        | 0,22              |
| 25 390 Fiserv Inc   | 2 869 832        | 0,11              | 44 400 Hongkong Land Holdings Ltd                                 | 194 916          | 0,01              |
| 4 126 FleetCor Technologies Inc                                   | 869 967          | 0,03              | 9 100 Horizon Therapeutics PLC                                    | 993 174          | 0,04              |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 59,06 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 59,06 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 13 360 Hormel Foods Corp  | 532 797          | 0,02              | 5 681 KLA Corp  | 2 267 685        | 0,09              |
| 15 726 Howmet Aerospace Inc                                       | 666 311          | 0,03              | 4 800 Knight-Swift Transportation Holdings Inc                    | 271 584          | 0,01              |
| 38 244 HP Inc   | 1 122 461        | 0,04              | 31 815 Kraft Heinz Co   | 1 230 286        | 0,05              |
| 2 300 Hubbell Inc   | 559 613          | 0,02              | 37 570 Kroger Co  | 1 854 831        | 0,07              |
| 1 900 HubSpot Inc   | 814 625          | 0,03              | 9 442 L3Harris Technologies Inc                                   | 1 852 898        | 0,07              |
| 6 005 Humana  | 2 915 187        | 0,11              | 5 385 Laboratory Corp of America Holdings                         | 1 235 427        | 0,05              |
| 50 246 Huntington Bancshares                                      | 562 755          | 0,02              | 5 689 Lam Research  | 3 015 853        | 0,11              |
| 1 182 Huntington Ingalls Industries Inc                           | 244 698          | 0,01              | 6 100 Lamb Weston Holdings Inc                                    | 637 572          | 0,02              |
| 3 650 IDEX Corp   | 843 259          | 0,03              | 18 944 Las Vegas Sands Corp                                       | 1 088 333        | 0,04              |
| 3 967 IDEXX Laboratories Inc                                      | 1 983 817        | 0,08              | 1 934 Lear Corp   | 269 774          | 0,01              |
| 13 376 Illinois Tool Works Inc                                    | 3 256 387        | 0,12              | 5 261 Leidos Holdings Inc   | 484 328          | 0,02              |
| 6 567 Illumina Inc  | 1 527 156        | 0,06              | 14 385 Lennar   | 1 512 007        | 0,06              |
| 10 676 Incyte Corp  | 771 555          | 0,03              | 1 064 Lennox International Inc                                    | 267 362          | 0,01              |
| 13 757 Ingersoll Rand Inc   | 800 382          | 0,03              | 4 122 Liberty Broadband Corp                                      | 336 767          | 0,01              |
| 31 300 Inner Mongolia Yitai Coal Co Ltd                           | 45 980           | 0,00              | 20 977 Liberty Global PLC (Class C)                               | 427 511          | 0,02              |
| 2 600 Insulet Corp  | 829 296          | 0,03              | 1 200 Liberty Media Corp  | 33 708           | 0,00              |
| 178 087 Intel Corp  | 5 818 102        | 0,22              | 6 900 Liberty Media Corp-Liberty Formula One                      | 516 327          | 0,02              |
| 23 802 Intercontinental Exchange Inc                              | 2 482 311        | 0,09              | 10 161 Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM                        | 284 406          | 0,01              |
| 38 777 International Business Machines Corp                       | 5 083 277        | 0,19              | 5 400 Live Nation Entertainment Inc                               | 378 000          | 0,01              |
| 9 244 International Flavors & Fragrances Inc                      | 850 078          | 0,03              | 11 785 LKQ Corp   | 668 917          | 0,03              |
| 15 310 International Paper Co                                     | 552 079          | 0,02              | 10 945 Lockheed Martin Corp                                       | 5 174 030        | 0,20              |
| 5 334 Interpublic Group   | 198 638          | 0,01              | 11 210 Loews Corp   | 650 404          | 0,02              |
| 11 169 Intuit   | 4 979 475        | 0,19              | 27 078 Lowe's Cos Inc   | 5 414 788        | 0,21              |
| 14 802 Intuitive Surgical Inc                                     | 3 781 467        | 0,14              | 2 900 LPL Financial Holdings Inc                                  | 586 960          | 0,02              |
| 15 371 Invesco Ltd  | 252 084          | 0,01              | 17 200 Lucid Group Inc  | 138 288          | 0,01              |
| 7 580 IQVIA Holdings Inc  | 1 507 586        | 0,06              | 4 832 Lululemon Athletica Inc                                     | 1 759 766        | 0,07              |
| 4 979 J M Smucker Co  | 783 545          | 0,03              | 12 517 LyondellBasell Industries NV                               | 1 175 221        | 0,04              |
| 2 668 Jack Henry & Associates Inc                                 | 402 121          | 0,02              | 6 238 M&T Bank  | 745 878          | 0,03              |
| 6 228 Jacobs Solutions Inc  | 731 852          | 0,03              | 24 600 Marathon Oil Corp  | 589 416          | 0,02              |
| 11 142 Jardine Matheson Holdings Ltd                              | 541 167          | 0,02              | 22 813 Marathon Petroleum Corp                                    | 3 075 877        | 0,12              |
| 1 871 Jazz Pharmaceuticals PLC                                    | 273 783          | 0,01              | 794 Markel Corp   | 1 014 264        | 0,04              |
| 2 700 JB Hunt Transport Services Inc                              | 473 742          | 0,02              | 1 300 MarketAxess Holdings Inc                                    | 508 677          | 0,02              |
| 113 939 Johnson & Johnson   | 17 660 545       | 0,67              | 13 130 Marriott International Inc/MD                              | 2 180 105        | 0,08              |
| 32 976 Johnson Controls International PLC                         | 1 985 815        | 0,08              | 20 807 Marsh & McLennan Cos Inc                                   | 3 465 406        | 0,13              |
| 126 415 JPMorgan Chase & Co                                       | 16 473 139       | 0,62              | 3 187 Martin Marietta Materials Inc                               | 1 131 576        | 0,04              |
| 18 411 Juniper Networks Inc                                       | 633 707          | 0,02              | 35 241 Marvell Technology Inc                                     | 1 525 935        | 0,06              |
| 11 703 Kellogg Co   | 783 633          | 0,03              | 11 051 Masco Corp   | 549 456          | 0,02              |
| 21 667 Keurig Dr Pepper Inc                                       | 764 412          | 0,03              | 1 700 Masimo Corp   | 313 718          | 0,01              |
| 48 005 KeyCorp  | 601 023          | 0,02              | 38 307 Mastercard Inc   | 13 921 147       | 0,53              |
| 9 608 Keysight Technologies Inc                                   | 1 551 500        | 0,06              | 9 870 Match Group Inc   | 378 909          | 0,01              |
| 14 707 Kimberly-Clark Corp  | 1 973 974        | 0,07              | 8 807 McCormick & Co Inc/MD                                       | 732 830          | 0,03              |
| 89 891 Kinder Morgan Inc  | 1 573 991        | 0,06              | 33 093 McDonald's Corp  | 9 253 134        | 0,35              |
| 21 524 KKR & Co Inc   | 1 130 440        | 0,04              | 5 235 McKesson Corp   | 1 863 922        | 0,07              |



## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 59,06 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 59,06 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 56 707 Medtronic PLC  | 4 571 718        | 0,17              | 10 349 NXP Semiconductors NV                                      | 1 929 830        | 0,07              |
| 2 215 MercadoLibre Inc  | 2 919 503        | 0,11              | 40 833 Occidental Petroleum Corp                                  | 2 549 204        | 0,10              |
| 109 191 Merck & Co Inc  | 11 616 830       | 0,44              | 6 400 Okta Inc  | 551 936          | 0,02              |
| 98 212 Meta Platforms Inc   | 20 815 051       | 0,79              | 3 523 Old Dominion Freight Line                                   | 1 200 779        | 0,05              |
| 25 290 MetLife Inc  | 1 465 303        | 0,06              | 11 581 Omnicom Group Inc  | 1 092 552        | 0,04              |
| 1 157 Mettler-Toledo International Inc                            | 1 770 453        | 0,07              | 18 024 ON Semiconductor Corp                                      | 1 483 736        | 0,06              |
| 22 971 MGM Resorts International                                  | 1 020 372        | 0,04              | 19 426 ONEOK Inc  | 1 234 328        | 0,05              |
| 21 664 Microchip Technology Inc                                   | 1 815 010        | 0,07              | 70 775 Oracle Corp  | 6 576 413        | 0,25              |
| 49 856 Micron Technology Inc                                      | 3 008 311        | 0,11              | 3 350 O'Reilly Automotive Inc                                     | 2 844 083        | 0,11              |
| 308 942 Microsoft Corp  | 89 067 979       | 3,38              | 17 630 Otis Worldwide Corp  | 1 487 972        | 0,06              |
| 14 312 Modema Inc   | 2 198 037        | 0,08              | 10 800 Ovintiv Inc  | 389 664          | 0,01              |
| 2 006 Mohawk Industries Inc                                       | 201 041          | 0,01              | 3 700 Owens Corning   | 354 460          | 0,01              |
| 2 100 Molina Healthcare Inc                                       | 561 729          | 0,02              | 23 190 PACCAR Inc   | 1 697 508        | 0,06              |
| 6 390 Molson Coors Beverage Co                                    | 330 235          | 0,01              | 6 618 Packaging Corp of America                                   | 918 777          | 0,03              |
| 57 816 Mondelez International Inc                                 | 4 030 932        | 0,15              | 68 433 Palantir Technologies Inc                                  | 578 259          | 0,02              |
| 3 100 MongoDB Inc   | 722 672          | 0,03              | 12 742 Palo Alto Networks Inc                                     | 2 545 087        | 0,10              |
| 1 800 Monolithic Power Systems Inc                                | 900 972          | 0,03              | 29 668 Paramount Global   | 661 893          | 0,03              |
| 37 158 Monster Beverage Corp                                      | 2 006 904        | 0,08              | 6 153 Parker-Hannifin Corp  | 2 068 085        | 0,08              |
| 7 420 Moody's Corp  | 2 270 668        | 0,09              | 13 402 Paychex  | 1 535 735        | 0,06              |
| 58 368 Morgan Stanley   | 5 124 710        | 0,19              | 1 900 Paycom Software Inc   | 577 619          | 0,02              |
| 13 023 Mosaic Co  | 597 495          | 0,02              | 1 500 Paylocity Holding Corp                                      | 298 170          | 0,01              |
| 7 718 Motorola Solutions Inc                                      | 2 208 351        | 0,08              | 48 069 PayPal Holdings Inc  | 3 650 360        | 0,14              |
| 3 898 MSCI Inc  | 2 181 672        | 0,08              | 4 694 Pentair PLC   | 259 437          | 0,01              |
| 11 400 Nasdaq Inc   | 623 238          | 0,02              | 58 608 PepsiCo  | 10 684 238       | 0,41              |
| 11 575 NetApp Inc   | 739 064          | 0,03              | 5 975 PerkinElmer   | 796 228          | 0,03              |
| 19 159 Netflix Inc  | 6 619 051        | 0,25              | 238 465 Pfizer Inc  | 9 729 372        | 0,37              |
| 3 000 Neurocrine Biosciences                                      | 303 660          | 0,01              | 53 224 PG&E Corp  | 860 632          | 0,03              |
| 23 011 New Linde PLC  | 8 179 030        | 0,31              | 66 743 Philip Morris International Inc                            | 6 490 757        | 0,25              |
| 16 821 Newell Brands Inc  | 209 253          | 0,01              | 17 197 Phillips 66  | 1 743 432        | 0,07              |
| 36 120 Newmont Mining   | 1 770 602        | 0,07              | 27 175 Pinterest Inc  | 741 062          | 0,03              |
| 12 914 News   | 223 025          | 0,01              | 7 950 Pioneer Natural Resources Co                                | 1 623 708        | 0,06              |
| 81 169 NextEra Energy Inc   | 6 256 507        | 0,24              | 26 000 Plug Power Inc   | 304 720          | 0,01              |
| 54 834 Nike   | 6 724 842        | 0,25              | 19 806 PNC Financial Services Group Inc                           | 2 517 343        | 0,10              |
| 18 899 NiSource Inc   | 528 416          | 0,02              | 1 800 Pool Corp   | 616 392          | 0,02              |
| 1 900 Nordson Corp  | 422 294          | 0,02              | 10 878 PPG Industries Inc   | 1 453 083        | 0,06              |
| 11 507 Norfolk Southern Corp                                      | 2 439 484        | 0,09              | 39 602 PPL Corp   | 1 100 540        | 0,04              |
| 10 155 Northern Trust Corp  | 894 960          | 0,03              | 15 690 Principal Financial Group Inc                              | 1 166 081        | 0,04              |
| 5 798 Northrop Grumman Corp                                       | 2 677 053        | 0,10              | 104 062 Procter & Gamble Co                                       | 15 472 979       | 0,59              |
| 3 800 Novocure Ltd  | 228 532          | 0,01              | 25 131 Progressive  | 3 595 241        | 0,14              |
| 11 085 NRG Energy Inc   | 380 105          | 0,01              | 14 896 Prudential Financial Inc                                   | 1 232 495        | 0,05              |
| 9 171 Nucor Corp  | 1 416 644        | 0,05              | 3 800 PTC Inc   | 487 274          | 0,02              |
| 107 972 NVIDIA Corp   | 29 991 382       | 1,14              | 25 236 Public Service Enterprise Group Inc                        | 1 575 988        | 0,06              |
| 82 NVR Inc  | 456 920          | 0,02              | 11 337 PulteGroup   | 660 720          | 0,02              |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 59,06 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 7 204 Qorvo Inc   | 731 710          | 0,03              |
| 49 963 QUALCOMM Inc   | 6 374 280        | 0,24              |
| 4 500 Quanta Services Inc   | 749 880          | 0,03              |
| 7 220 Quest Diagnostics   | 1 021 486        | 0,04              |
| 9 351 Raymond James Financial Inc                                 | 872 168          | 0,03              |
| 63 935 Raytheon Technologies Corp                                 | 6 261 155        | 0,24              |
| 4 463 Regeneron Pharmaceuticals Inc                               | 3 667 113        | 0,14              |
| 49 958 Regions Financial Corp                                     | 927 220          | 0,04              |
| 2 600 Reliance Steel & Aluminum Co                                | 667 524          | 0,03              |
| 2 000 Repligen Corp   | 336 720          | 0,01              |
| 9 381 Republic Services Inc                                       | 1 268 499        | 0,05              |
| 6 880 ResMed Inc  | 1 506 651        | 0,06              |
| 13 500 Rivian Automotive Inc                                      | 208 980          | 0,01              |
| 4 311 Robert Half International Inc                               | 347 337          | 0,01              |
| 18 300 ROBLOX Corp  | 823 134          | 0,03              |
| 5 791 Rockwell Automation Inc                                     | 1 699 369        | 0,06              |
| 5 800 Roku Inc  | 381 756          | 0,01              |
| 7 350 Rollins Inc   | 275 845          | 0,01              |
| 4 458 Roper Technologies  | 1 964 596        | 0,07              |
| 16 682 Ross Stores  | 1 770 461        | 0,07              |
| 7 892 Royal Caribbean Cruises Ltd                                 | 515 348          | 0,02              |
| 16 800 Royalty Pharma PLC   | 605 304          | 0,02              |
| 2 400 RPM International Inc                                       | 209 376          | 0,01              |
| 16 345 S&P Global Inc   | 5 635 266        | 0,21              |
| 42 521 Salesforce Inc   | 8 494 845        | 0,32              |
| 63 642 Schlumberger Ltd   | 3 124 822        | 0,12              |
| 12 989 Seagate Technology Holdings PLC                            | 858 833          | 0,03              |
| 5 400 Seagen Inc  | 1 093 338        | 0,04              |
| 5 200 Sealed Air Corp   | 238 732          | 0,01              |
| 3 326 SEI Investments Co  | 191 411          | 0,01              |
| 12 428 Sempra Energy  | 1 878 616        | 0,07              |
| 5 500 Sensata Technologies Holding PLC                            | 275 110          | 0,01              |
| 8 596 ServiceNow Inc  | 3 994 733        | 0,15              |
| 108 564 Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co Ltd | 83 920           | 0,00              |
| 11 212 Sherwin-Williams   | 2 520 121        | 0,10              |
| 53 400 Sirius XM Holdings Inc                                     | 211 998          | 0,01              |
| 9 228 Skyworks Solutions Inc                                      | 1 088 719        | 0,04              |
| 47 632 Snap Inc   | 533 955          | 0,02              |
| 1 900 Snap-on   | 469 091          | 0,02              |
| 9 497 Snowflake Inc   | 1 465 292        | 0,06              |
| 2 400 SolarEdge Technologies Inc                                  | 729 480          | 0,03              |
| 43 490 Southern Co  | 3 026 034        | 0,11              |
| 4 200 Southern Copper Corp  | 320 250          | 0,01              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 59,06 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 4 800 Southwest Airlines Co                                       | 156 192          | 0,01              |
| 6 736 Splunk Inc  | 645 848          | 0,02              |
| 10 368 SS&C Technologies Holdings Inc                             | 585 481          | 0,02              |
| 7 131 Stanley Black & Decker Inc                                  | 574 616          | 0,02              |
| 53 135 Starbucks Corp   | 5 532 948        | 0,21              |
| 16 977 State Street Corp  | 1 284 989        | 0,05              |
| 8 609 Steel Dynamics Inc  | 973 334          | 0,04              |
| 4 900 STERIS PLC  | 937 272          | 0,04              |
| 14 344 Stryker  | 4 094 782        | 0,16              |
| 20 317 Synchrony Financial  | 590 818          | 0,02              |
| 7 197 Synopsys Inc  | 2 779 841        | 0,11              |
| 21 336 Sysco Corp   | 1 647 779        | 0,06              |
| 11 279 T Rowe Price Group Inc                                     | 1 273 399        | 0,05              |
| 6 995 Take-Two Interactive Software Inc                           | 834 503          | 0,03              |
| 6 500 Targa Resources Corp  | 474 175          | 0,02              |
| 20 028 Target   | 3 317 238        | 0,13              |
| 15 772 TE Connectivity Ltd  | 2 068 498        | 0,08              |
| 1 300 Teledyne Technologies Inc                                   | 581 568          | 0,02              |
| 2 646 Teleflex Inc  | 670 258          | 0,03              |
| 7 612 Teradyne Inc  | 818 366          | 0,03              |
| 115 827 Tesla Inc   | 24 029 469       | 0,91              |
| 41 545 Texas Instruments Inc                                      | 7 727 785        | 0,29              |
| 300 Texas Pacific Land Corp                                       | 510 306          | 0,02              |
| 8 710 Tectron Inc   | 615 187          | 0,02              |
| 17 167 Thermo Fisher Scientific                                   | 9 894 544        | 0,38              |
| 53 814 TJX Cos Inc  | 4 216 865        | 0,16              |
| 26 841 T-Mobile US Inc  | 3 887 650        | 0,15              |
| 9 700 Toast Inc   | 172 175          | 0,01              |
| 4 600 Toro Co   | 511 336          | 0,02              |
| 6 786 Tractor Supply Co   | 1 594 981        | 0,06              |
| 18 697 Trade Desk Inc   | 1 138 834        | 0,04              |
| 5 000 Tradeweb Markets Inc  | 395 100          | 0,01              |
| 11 123 Trane Technologies PLC                                     | 2 046 410        | 0,08              |
| 2 026 TransDigm Group Inc   | 1 493 263        | 0,06              |
| 9 727 TransUnion  | 604 436          | 0,02              |
| 10 928 Travelers Cos Inc  | 1 873 168        | 0,07              |
| 13 899 Trimble Inc  | 728 586          | 0,03              |
| 59 511 Truist Financial Corp                                      | 2 029 325        | 0,08              |
| 7 108 Twilio Inc  | 473 606          | 0,02              |
| 1 400 Tyler Technologies Inc                                      | 496 496          | 0,02              |
| 14 408 Tyson Foods Inc  | 854 683          | 0,03              |
| 63 634 Uber Technologies Inc                                      | 2 017 198        | 0,08              |
| 7 504 UGI Corp  | 260 839          | 0,01              |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 59,06 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 2 700 U-Haul Holding Co   | 139 995          | 0,01              |
| 2 942 Ulta Beauty Inc   | 1 605 361        | 0,06              |
| 26 010 Union Pacific  | 5 234 773        | 0,20              |
| 30 328 United Parcel Service                                      | 5 883 329        | 0,22              |
| 2 497 United Rentals Inc  | 988 213          | 0,04              |
| 2 000 United Therapeutics Corp                                    | 447 920          | 0,02              |
| 40 484 UnitedHealth Group Inc                                     | 19 132 334       | 0,73              |
| 10 500 Unity Software Inc   | 340 620          | 0,01              |
| 2 891 Universal Health Services Inc                               | 367 446          | 0,01              |
| 55 654 US Bancorp   | 2 006 327        | 0,08              |
| 1 483 Vail Resorts Inc  | 346 547          | 0,01              |
| 18 811 Valero Energy Corp   | 2 626 016        | 0,10              |
| 6 277 Veeva Systems Inc   | 1 153 650        | 0,04              |
| 4 632 VeriSign Inc  | 978 881          | 0,04              |
| 7 131 Verisk Analytics Inc  | 1 368 154        | 0,05              |
| 175 335 Verizon Communications Inc                                | 6 818 778        | 0,26              |
| 11 750 Vertex Pharmaceuticals Inc                                 | 3 702 072        | 0,14              |
| 15 419 VF Corp  | 353 249          | 0,01              |
| 65 093 Viatris Inc  | 626 195          | 0,02              |
| 72 812 Visa Inc   | 16 416 194       | 0,62              |
| 17 377 Vistra Corp  | 417 048          | 0,02              |
| 7 955 VMware Inc  | 993 182          | 0,04              |
| 6 320 Vulcan Materials Co   | 1 084 259        | 0,04              |
| 10 555 W. R. Berkley  | 657 154          | 0,02              |
| 31 805 Walgreens Boots Alliance Inc                               | 1 099 817        | 0,04              |
| 63 854 Walmart Inc  | 9 415 272        | 0,36              |
| 77 605 Walt Disney Co   | 7 770 589        | 0,29              |
| 106 232 Warner Bros Discovery Inc                                 | 1 604 103        | 0,06              |
| 12 370 Waste Connections Inc                                      | 1 720 296        | 0,07              |
| 17 455 Waste Management Inc                                       | 2 848 132        | 0,11              |
| 3 210 Waters Corp   | 993 912          | 0,04              |
| 9 200 Webster Financial Corp                                      | 362 664          | 0,01              |
| 14 207 WEC Energy Group Inc                                       | 1 346 682        | 0,05              |
| 166 561 Wells Fargo & Co  | 6 226 050        | 0,24              |
| 2 500 West Pharmaceutical Services                                | 866 175          | 0,03              |
| 14 013 Western Digital Corp                                       | 527 870          | 0,02              |
| 8 375 Westinghouse Air Brake Technologies Corp                    | 846 377          | 0,03              |
| 8 917 Westrock Co   | 271 701          | 0,01              |
| 2 096 Whirlpool Corp  | 276 714          | 0,01              |
| 53 821 Williams Cos Inc   | 1 607 095        | 0,06              |
| 3 731 Willis Towers Watson PLC                                    | 867 010          | 0,03              |
| 2 100 Wix.com Ltd   | 209 580          | 0,01              |
| 4 900 Wolfspeed Inc   | 318 255          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD     | % des actifs nets |
|---|----------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b>   |                      |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b>   |                      |                   |
| <b>Dollar américain – 59,06 % (suite)</b>                           |                      |                   |
| 8 102 Workday Inc   | 1 673 387            | 0,06              |
| 2 031 WW Grainger Inc   | 1 398 973            | 0,05              |
| 5 808 Wynn Resorts Ltd  | 649 973              | 0,02              |
| 20 444 Xcel Energy Inc  | 1 378 743            | 0,05              |
| 10 431 Xylem Inc/NY   | 1 092 126            | 0,04              |
| 16 750 Yum China Holdings Inc                                       | 1 061 782            | 0,04              |
| 11 357 Yum! Brands Inc  | 1 500 033            | 0,06              |
| 1 900 Zebra Technologies Corp                                       | 604 200              | 0,02              |
| 7 675 Zillow Group Inc  | 341 307              | 0,01              |
| 9 076 Zimmer Biomet Holdings Inc                                    | 1 172 619            | 0,04              |
| 21 716 Zoetis Inc   | 3 614 411            | 0,14              |
| 9 297 Zoom Video Communications Inc                                 | 686 490              | 0,03              |
| 8 900 ZoomInfo Technologies Inc                                     | 219 919              | 0,01              |
| 3 400 Zscaler Inc   | 397 222              | 0,01              |
|   | <b>1 557 242 950</b> | <b>59,06</b>      |
| <b>Yuan Renminbi – 0,53 %</b>                                       |                      |                   |
| 23 900 37 Interactive Entertainment Network Technology Group Co Ltd | 99 013               | 0,01              |
| 3 500 AECC Aviation Power Co Ltd                                    | 21 992               | 0,00              |
| 6 000 Aier Eye Hospital Group Co Ltd                                | 27 146               | 0,00              |
| 52 300 Anhui Conch Cement Co Ltd                                    | 215 146              | 0,01              |
| 700 Anhui Gujing Distillery Co Ltd                                  | 30 172               | 0,00              |
| 18 700 Apeloia Pharmaceutical Co Ltd                                | 58 001               | 0,00              |
| 4 200 Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd                          | 81 544               | 0,00              |
| 10 800 AVICOPTER PLC  | 66 540               | 0,00              |
| 105 100 Bank of China Ltd   | 51 729               | 0,00              |
| 15 400 Beijing Enlight Media Co Ltd                                 | 19 936               | 0,00              |
| 750 Beijing Kingsoft Office Software Inc                            | 51 658               | 0,00              |
| 30 772 Beijing Shiji Information Technology Co Ltd                  | 114 981              | 0,01              |
| 13 100 BYD Co Ltd (Class A)   | 488 382              | 0,02              |
| 2 200 Chengxin Lithium Group Co Ltd                                 | 11 062               | 0,00              |
| 26 500 China Baoan Group Co Ltd                                     | 43 875               | 0,00              |
| 37 800 China Construction Bank Corp                                 | 32 696               | 0,00              |
| 42 600 China Eastern Airlines Corp Ltd                              | 31 947               | 0,00              |
| 29 500 China Merchants Bank Co Ltd                                  | 147 214              | 0,01              |
| 2 300 China Northern Rare Earth Group High-Tech Co Ltd              | 8 738                | 0,00              |
| 2 800 China Rare Earth Resources And Technology Co Ltd              | 13 769               | 0,00              |
| 518 100 China State Construction Engineering Corp Ltd               | 437 578              | 0,02              |
| 3 300 China Tourism Group Duty Free Corp Ltd                        | 88 054               | 0,00              |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Yuan Renminbi – 0,53 % (suite)</b>                             |                  |                   | <b>Yuan Renminbi – 0,53 % (suite)</b>                             |                  |                   |
| 54 200 China United Network Communications Ltd                    | 42 777           | 0,00              | 15 400 JA Solar Technology Co Ltd                                 | 128 586          | 0,01              |
| 60 900 China Vanke Co Ltd   | 135 150          | 0,01              | 24 168 Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co Ltd                     | 150 696          | 0,01              |
| 26 000 China Yangtze Power Co Ltd                                 | 80 454           | 0,00              | 2 000 Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd                   | 48 188           | 0,00              |
| 6 100 Chongqing Brewery Co Ltd                                    | 111 033          | 0,01              | 19 200 Jiangsu Zhongtian Technology Co Ltd                        | 47 781           | 0,00              |
| 6 000 Chongqing Zhifei Biological Products Co Ltd                 | 71 583           | 0,00              | 15 200 Jiangxi Special Electric Motor Co Ltd                      | 34 064           | 0,00              |
| 106 050 CITIC Securities Co Ltd                                   | 316 268          | 0,01              | 6 900 JiuGui Liquor Co Ltd  | 129 946          | 0,01              |
| 13 500 Contemporary Amperex Technology Co Ltd                     | 798 229          | 0,03              | 106 900 Jizhong Energy Resources Co Ltd                           | 106 475          | 0,01              |
| 106 400 COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd (Class A)     | 209 785          | 0,01              | 3 500 Kweichow Moutai Co Ltd                                      | 927 584          | 0,04              |
| 48 100 COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd                             | 77 256           | 0,00              | 26 460 LONGi Green Energy Technology Co Ltd                       | 155 701          | 0,01              |
| 29 600 Daan Gene Co Ltd   | 69 439           | 0,00              | 51 998 Luxshare Precision Industry Co Ltd                         | 229 502          | 0,01              |
| 10 600 DHC Software Co Ltd  | 12 811           | 0,00              | 2 500 Luzhou Laojiao Co Ltd                                       | 92 755           | 0,00              |
| 54 840 East Money Information Co Ltd                              | 159 953          | 0,01              | 8 200 Mango Excellent Media Co Ltd                                | 44 467           | 0,00              |
| 9 400 Ecovacs Robotics Co Ltd                                     | 113 063          | 0,01              | 13 328 Muyuan Foods Co Ltd  | 95 099           | 0,00              |
| 11 200 ENN Natural Gas Co Ltd                                     | 34 005           | 0,00              | 21 970 Nanjing King-Friend Biochemical Pharmaceutical Co Ltd      | 52 147           | 0,00              |
| 2 000 Eve Energy Co Ltd   | 20 299           | 0,00              | 7 100 NAURA Technology Group Co Ltd                               | 274 858          | 0,01              |
| 5 700 Flat Glass Group Co Ltd                                     | 28 478           | 0,00              | 8 400 New China Life Insurance Co Ltd                             | 37 307           | 0,00              |
| 6 349 Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd                     | 70 763           | 0,00              | 19 600 New Hope Liuhe Co Ltd                                      | 37 760           | 0,00              |
| 1 820 Ganfeng Lithium Group Co Ltd                                | 17 616           | 0,00              | 6 000 Ningbo Orient Wires & Cables Co Ltd                         | 43 082           | 0,00              |
| 2 000 G-bits Network Technology Xiamen Co Ltd                     | 138 849          | 0,01              | 3 439 Ningbo Ronbay New Energy Technology Co Ltd                  | 34 253           | 0,00              |
| 1 176 GigaDevice Semiconductor Inc                                | 20 892           | 0,00              | 17 849 Ovctek China Inc   | 86 083           | 0,00              |
| 745 Ginlong Technologies Co Ltd                                   | 14 491           | 0,00              | 26 700 Perfect World Co Ltd/China                                 | 66 174           | 0,00              |
| 2 200 Great Wall Motor Co Ltd                                     | 8 948            | 0,00              | 134 100 PetroChina Co Ltd   | 115 602          | 0,01              |
| 63 500 Guanghui Energy Co Ltd                                     | 85 532           | 0,00              | 53 800 Ping An Bank Co Ltd  | 98 163           | 0,01              |
| 19 720 Guangzhou Tinci Materials Technology Co Ltd                | 120 492          | 0,01              | 9 500 Ping An Insurance Group Co of China Ltd                     | 63 082           | 0,00              |
| 47 500 Haitong Securities Co Ltd                                  | 60 937           | 0,00              | 67 800 Pingdingshan Tianan Coal Mining Co Ltd                     | 102 382          | 0,01              |
| 2 800 Hangzhou First Applied Material Co Ltd                      | 23 954           | 0,00              | 94 600 Poly Developments and Holdings Group Co Ltd                | 194 647          | 0,01              |
| 7 350 Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd                         | 102 437          | 0,01              | 3 100 Sangfor Technologies Inc                                    | 66 791           | 0,00              |
| 94 800 Huadian Power International Corp Ltd                       | 79 928           | 0,00              | 20 700 SF Holding Co Ltd  | 166 931          | 0,01              |
| 8 970 Hualan Biological Engineering Inc                           | 28 514           | 0,00              | 2 475 SG Micro Corp   | 55 935           | 0,00              |
| 46 200 Huaneng Power International Inc                            | 57 655           | 0,00              | 29 900 Shan Xi Hua Yang Group New Energy Co Ltd                   | 60 172           | 0,00              |
| 12 539 Hundsun Technologies Inc                                   | 97 174           | 0,01              | 21 980 Shandong Gold Mining Co Ltd                                | 70 543           | 0,00              |
| 9 200 Iflytek Co Ltd  | 85 311           | 0,00              | 2 156 Shanghai Bairun Investment Holding Group Co Ltd             | 12 844           | 0,00              |
| 33 200 Industrial Bank Co Ltd                                     | 81 655           | 0,00              | 27 885 Shanghai Baosight Software Co Ltd                          | 236 324          | 0,01              |
| 17 900 Inner Mongolia Dian Tou Energy Corp Ltd                    | 35 032           | 0,00              | 7 100 Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd                  | 33 488           | 0,00              |
| 46 800 Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd                | 198 450          | 0,01              | 3 676 Shanghai Fudan Microelectronics Group Co Ltd                | 35 040           | 0,00              |
| 5 000 Inspur Electronic Information Industry Co Ltd               | 25 556           | 0,00              |   |                  |                   |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Yuan Renminbi – 0,53 % (suite)</b>                             |                  |                   |
| 15 200 Shanghai Jinjiang International Hotels Co Ltd              | 139 244          | 0,01              |
| 13 368 Shanghai Junshi Biosciences Co Ltd                         | 93 516           | 0,00              |
| 810 Shanghai Medicilon Inc  | 18 405           | 0,00              |
| 46 800 Shanxi Coking Coal Energy Group Co Ltd                     | 74 896           | 0,00              |
| 49 900 Shanxi Lu'an Environmental Energy Development Co Ltd       | 159 423          | 0,01              |
| 39 500 Shanxi Meijin Energy Co Ltd                                | 52 802           | 0,00              |
| 2 240 Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd                   | 88 852           | 0,00              |
| 24 100 Shengyi Technology Co Ltd                                  | 64 783           | 0,00              |
| 1 120 Shennan Circuits Co Ltd                                     | 15 057           | 0,00              |
| 128 520 Shenzhen Energy Group Co Ltd                              | 114 347          | 0,01              |
| 8 960 Shenzhen Kangtai Biological Products Co Ltd                 | 41 282           | 0,00              |
| 3 000 Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd             | 136 171          | 0,01              |
| 5 400 Shenzhen SC New Energy Technology Corp                      | 89 996           | 0,00              |
| 25 100 Shijiazhuang Yiling Pharmaceutical Co Ltd                  | 106 397          | 0,01              |
| 6 100 Sichuan New Energy Power Co Ltd                             | 14 141           | 0,00              |
| 2 800 Sichuan Swellfun Co Ltd                                     | 30 714           | 0,00              |
| 6 440 Sinomine Resource Group Co Ltd                              | 65 926           | 0,00              |
| 54 500 Songcheng Performance Development Co Ltd                   | 129 121          | 0,01              |
| 4 700 Sungrow Power Supply Co Ltd                                 | 71 767           | 0,00              |
| 2 600 Suzhou TA&A Ultra Clean Technology Co Ltd                   | 19 381           | 0,00              |
| 12 900 Thunder Software Technology Co Ltd                         | 203 532          | 0,01              |
| 61 300 Tianshui Huatian Technology Co Ltd                         | 90 156           | 0,00              |
| 26 500 Titan Wind Energy Suzhou Co Ltd                            | 56 957           | 0,00              |
| 29 900 TongFu Microelectronics Co Ltd                             | 96 658           | 0,01              |
| 7 800 Tongwei Co Ltd  | 44 195           | 0,00              |
| 5 302 Trina Solar Co Ltd  | 40 217           | 0,00              |
| 6 000 Tsingtao Brewery Co Ltd                                     | 105 369          | 0,01              |
| 19 200 Walvax Biotechnology Co Ltd                                | 96 429           | 0,01              |
| 28 100 Wanhua Chemical Group Co Ltd                               | 392 327          | 0,02              |
| 37 100 Weichai Power Co Ltd                                       | 68 124           | 0,00              |
| 11 880 Wens Foodstuffs Group Co Ltd                               | 35 412           | 0,00              |
| 1 350 Will Semiconductor Co Ltd Shanghai                          | 17 909           | 0,00              |
| 43 649 Wuhan Guide Infrared Co Ltd                                | 76 845           | 0,00              |
| 11 300 Wuliangye Yibin Co Ltd                                     | 324 159          | 0,01              |
| 11 440 WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd                         | 35 799           | 0,00              |
| 21 100 WuXi AppTec Co Ltd   | 244 266          | 0,01              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD     | % des actifs nets |
|---|----------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b>         |                      |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,71 % (mars 2022 : 96,49 %) (suite)</b>         |                      |                   |
| <b>Yuan Renminbi – 0,53 % (suite)</b>                                     |                      |                   |
| 32 800 Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd                      | 52 730               | 0,00              |
| 9 300 Yankuang Energy Group Co Ltd  | 48 170               | 0,00              |
| 4 100 Yantai Jereh Oilfield Services Group Co Ltd                         | 16 908               | 0,00              |
| 5 700 Yealink Network Technology Corp Ltd                                 | 63 090               | 0,00              |
| 23 380 Yintai Gold Co Ltd   | 44 838               | 0,00              |
| 26 260 Yonyou Network Technology Co Ltd                                   | 96 172               | 0,00              |
| 1 900 Youngy Co Ltd   | 20 964               | 0,00              |
| 100 400 Zhejiang Century Huatong Group Co Ltd                             | 88 013               | 0,00              |
| 11 500 Zhejiang Huahai Pharmaceutical Co Ltd                              | 33 777               | 0,00              |
| 3 000 Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd                   | 28 522               | 0,00              |
| 6 900 Zhejiang Jiuzhou Pharmaceutical Co Ltd                              | 33 439               | 0,00              |
| 6 800 Zhejiang Yongtai Technology Co Ltd                                  | 20 715               | 0,00              |
| 2 800 Zhongji Innolight Co Ltd  | 24 015               | 0,00              |
| 6 000 Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd                                  | 41 711               | 0,00              |
| 8 800 ZTE Corp (Class A)  | 41 724               | 0,00              |
|   | <b>14 019 757</b>    | <b>0,53</b>       |
| <b>Total des actions ordinaires</b>                                       |                      |                   |
|   | <b>2 550 208 764</b> | <b>96,71</b>      |
| <b>Certificats représentatifs de titres – 0,60 % (mars 2022 : 0,75 %)</b> |                      |                   |
| <b>Dollar australien – 0,01 %</b>   |                      |                   |
| 13 592 James Hardie Industries PLC  | 289 756              | 0,01              |
|   | <b>289 756</b>       | <b>0,01</b>       |
| <b>Réal brésilien – 0,00 %</b>  |                      |                   |
| 1 Inter & Co Inc  | 1                    | 0,00              |
|   | <b>1</b>             | <b>0,00</b>       |
| <b>Euro – 0,01 %</b>  |                      |                   |
| 15 630 ABN AMRO Bank NV   | 248 265              | 0,01              |
|   | <b>248 265</b>       | <b>0,01</b>       |
| <b>Baht thaïlandais – 0,18 %</b>  |                      |                   |
| 51 600 Advanced Info Service PCL  | 319 906              | 0,01              |
| 44 600 Airports of Thailand PCL   | 92 604               | 0,00              |
| 377 500 Bangkok Dusit Medical Services PCL                                | 325 669              | 0,01              |
| 796 800 Bangkok Expressway & Metro PCL                                    | 206 220              | 0,01              |
| 949 500 BTS Group Holdings PCL  | 197 147              | 0,01              |
| 9 500 Bumrungrad Hospital PCL (Non voting rights)                         | 62 787               | 0,00              |
| 45 600 Central Pattana PCL  | 91 680               | 0,00              |
| 97 029 Central Retail Corp PCL  | 126 979              | 0,01              |
| 59 200 Charoen Pokphand Foods PCL   | 36 702               | 0,00              |
| 479 100 CP ALL PCL  | 868 671              | 0,03              |
| 13 600 Delta Electronics Thailand PCL                                     | 454 195              | 0,02              |
| 5 600 Electricity Generating PCL  | 25 466               | 0,00              |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b>                 |                  |                   |
| <b>Certificats représentatifs de titres – 0,60 % (mars 2022 : 0,75 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Baht thaïlandais – 0,18 % (suite)</b>  |                  |                   |
| 54 700 Energy Absolute PCL  | 121 573          | 0,01              |
| 101 200 Gulf Energy Development PCL   | 156 114          | 0,01              |
| 207 000 Home Product Center PCL   | 87 171           | 0,00              |
| 67 500 Indorama Ventures PCL  | 68 102           | 0,00              |
| 10 400 Kasikornbank PCL   | 40 298           | 0,00              |
| 335 100 Land & Houses PCL   | 96 527           | 0,00              |
| 48 400 PTT Exploration & Production PCL   | 213 020          | 0,01              |
| 41 600 PTT Global Chemical PCL  | 55 657           | 0,00              |
| 51 100 SCB X PCL  | 153 173          | 0,01              |
| 74 000 Siam Cement PCL  | 681 679          | 0,03              |
| 95 586 Thai Oil PCL   | 146 754          | 0,01              |
| 133 300 Thai Union Group PCL  | 54 965           | 0,00              |
|   | <b>4 683 059</b> | <b>0,18</b>       |
| <b>Dollar américain – 0,40 %</b>  |                  |                   |
| 4 900 360 DigiTech Inc  | 95 060           | 0,00              |
| 3 100 Autohome Inc  | 103 757          | 0,00              |
| 28 153 Cia de Minas Buenaventura SAA  | 230 292          | 0,01              |
| 3 900 Daqo New Energy Corp  | 182 676          | 0,01              |
| 2 900 Futu Holdings Ltd   | 150 365          | 0,01              |
| 8 300 H World Group Ltd   | 406 534          | 0,02              |
| 112 917 Infosys   | 1 969 273        | 0,07              |
| 48 700 iQIYI Inc  | 354 536          | 0,01              |
| 3 200 JOYY Inc  | 99 776           | 0,00              |
| 5 000 Kanzhun Ltd   | 95 150           | 0,00              |
| 23 000 KE Holdings Inc  | 433 320          | 0,02              |
| 2 800 Legend Biotech Corp   | 135 016          | 0,00              |
| 18 400 Lufax Holding Ltd  | 37 536           | 0,00              |
| 1 Magnit PJSC   | -                | 0,00              |
| 12 846 Mobile TeleSystems PJSC  | -                | 0,00              |
| 54 671 NIO Inc  | 574 592          | 0,02              |
| 19 773 PDD Holdings Inc   | 1 500 771        | 0,06              |
| 15 691 Sea Ltd  | 1 358 056        | 0,05              |
| 26 754 TAL Education Group  | 171 493          | 0,01              |
| 5 000 TCS Group Holding PLC   | -                | 0,00              |
| 30 900 Tencent Music Entertainment Group  | 255 852          | 0,01              |
| 42 198 Teva Pharmaceutical Industries Ltd   | 373 452          | 0,01              |
| 28 035 Trip.com Group Ltd   | 1 056 079        | 0,04              |
| 13 000 Vipshop Holdings Ltd   | 197 340          | 0,01              |
| 1 740 Weibo Corp  | 34 904           | 0,00              |
| 3 788 X5 Retail Group NV  | -                | 0,00              |
| 5 869 Zai Lab Ltd   | 195 203          | 0,01              |

| Participation Investissement   | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|--|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b>                  |                   |                   |
| <b>Certificats représentatifs de titres – 0,60 % (mars 2022 : 0,75 %) (suite)</b>  |                   |                   |
| <b>Dollar américain – 0,40 % (suite)</b>   |                   |                   |
| 24 673 ZTO Express Cayman Inc  | 707 128           | 0,03              |
|  | <b>10 718 161</b> | <b>0,40</b>       |
| <b>Total des certificats représentatifs de titres</b>                              |                   |                   |
|  | <b>15 939 242</b> | <b>0,60</b>       |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 1,78 % (mars 2022 : 1,97 %)</b> |                   |                   |
| <b>Dollar australien – 0,09 %</b>  |                   |                   |
| 36 317 Dexus   | 182 668           | 0,01              |
| 74 061 Goodman Group   | 932 029           | 0,03              |
| 53 795 GPT Group   | 152 764           | 0,01              |
| 107 104 Mirvac Group   | 149 205           | 0,00              |
| 243 735 Scentre Group  | 448 914           | 0,02              |
| 58 101 Stockland   | 154 874           | 0,01              |
| 171 663 Vicinity Ltd   | 223 619           | 0,01              |
|  | <b>2 244 073</b>  | <b>0,09</b>       |
| <b>Dollar canadien – 0,00 %</b>  |                   |                   |
| 2 000 Canadian Apartment Properties REIT   | 70 063            | 0,00              |
| 2 500 RioCan Real Estate Investment Trust  | 37 666            | 0,00              |
|  | <b>107 729</b>    | <b>0,00</b>       |
| <b>Euro – 0,03 %</b>   |                   |                   |
| 1 452 Covivio  | 84 556            | 0,00              |
| 1 391 Gecina SA  | 144 400           | 0,01              |
| 6 926 Klepierre SA   | 156 891           | 0,01              |
| 6 566 Unibail-Rodamco-Westfield  | 352 294           | 0,01              |
| 4 182 Warehouses De Pauw CVA   | 124 129           | 0,00              |
|  | <b>862 270</b>    | <b>0,03</b>       |
| <b>Dollar de Hong Kong – 0,03 %</b>  |                   |                   |
| 105 068 Link REIT  | 675 919           | 0,03              |
|  | <b>675 919</b>    | <b>0,03</b>       |
| <b>Yen japonais – 0,05 %</b>   |                   |                   |
| 82 Daiwa House REIT Investment Corp  | 167 278           | 0,01              |
| 88 GLP J-Reit  | 94 619            | 0,00              |
| 224 Japan Metropolitan Fund Invest   | 162 753           | 0,00              |
| 52 Japan Real Estate Investment Corp   | 206 296           | 0,01              |
| 46 Nippon Building Fund Inc  | 190 442           | 0,01              |
| 93 Nippon Prologis REIT Inc  | 195 867           | 0,01              |
| 169 Nomura Real Estate Master Fund Inc   | 188 568           | 0,01              |
|  | <b>1 205 823</b>  | <b>0,05</b>       |
| <b>Peso mexicain – 0,00 %</b>  |                   |                   |
| 79 752 Fibra Uno Administracion SA de CV   | 111 174           | 0,00              |
| 19 600 Operadora De Sites Mexicanos SAB de CV                                      | 19 344            | 0,00              |
|  | <b>130 518</b>    | <b>0,00</b>       |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|--|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b>                          |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)</b>                          |                   |                   |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 1,78 % (mars 2022 : 1,97 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 1,78 % (mars 2022 : 1,97 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Livre sterling – 0,03 %</b>   |                  |                   | <b>Dollar américain – 1,52 % (suite)</b>   |                   |                   |
| 37 710 British Land Co PLC   | 180 818          | 0,01              | 17 668 UDR Inc   | 725 448           | 0,03              |
| 23 371 Land Securities Group PLC   | 179 508          | 0,01              | 18 645 Ventas Inc  | 808 261           | 0,03              |
| 41 104 Segro PLC   | 390 118          | 0,01              | 33 573 VICI Properties Inc   | 1 095 151         | 0,04              |
|  | <b>750 444</b>   | <b>0,03</b>       | 18 131 Welltower Inc   | 1 299 812         | 0,05              |
| <b>Dollar de Singapour – 0,03 %</b>  |                  |                   | 32 392 Weyerhaeuser Co   | 975 971           | 0,04              |
| 161 913 CapitalLand Ascendas REIT  | 348 291          | 0,01              | 11 583 WP Carey Inc  | 897 103           | 0,03              |
| 247 470 CapitalLand Integrated Commercial Trust  | 368 539          | 0,02              |  | <b>40 095 097</b> | <b>1,52</b>       |
|  | <b>716 830</b>   | <b>0,03</b>       | <b>Total des fiducies de placement immobilier de type REIT</b>                             |                   |                   |
| <b>Rand sud-africain – 0,00 %</b>  |                  |                   |  | <b>46 852 565</b> | <b>1,78</b>       |
| 86 759 Growthpoint Properties Ltd  | 63 862           | 0,00              | <b>Actions préférentielles – 0,34 % (mars 2022 : 0,39 %)</b>                               |                   |                   |
|  | <b>63 862</b>    | <b>0,00</b>       | <b>Réal brésilien – 0,11 %</b>   |                   |                   |
| <b>Dollar américain – 1,52 %</b>   |                  |                   | 325 606 Banco Bradesco SA  | 845 763           | 0,03              |
| 5 903 Alexandria Real Estate Equities Inc  | 741 358          | 0,03              | 9 800 Centrais Eletricas Brasileiras SA (Non voting rights)                                | 70 124            | 0,00              |
| 9 500 American Homes 4 Rent  | 298 775          | 0,01              | 44 536 Cia Energetica de Minas Gerais (Non voting rights)                                  | 100 486           | 0,00              |
| 19 111 American Tower Corp   | 3 905 142        | 0,15              | 21 945 Gerdau SA   | 109 460           | 0,00              |
| 7 264 Annaly Capital Management Inc  | 138 815          | 0,01              | 192 839 Itau Unibanco Holding SA   | 940 947           | 0,04              |
| 5 555 AvalonBay Communities  | 933 573          | 0,04              | 82 906 Itausa SA   | 134 409           | 0,01              |
| 8 316 Boston Properties  | 450 062          | 0,02              | 140 074 Petroleo Brasileiro SA   | 647 845           | 0,03              |
| 3 300 Camden Property Trust  | 345 972          | 0,01              |  | <b>2 849 034</b>  | <b>0,11</b>       |
| 17 531 Crown Castle Inc  | 2 346 349        | 0,09              | <b>Peso chilien – 0,02 %</b>   |                   |                   |
| 11 262 Digital Realty Trust Inc  | 1 107 167        | 0,04              | 5 478 Sociedad Quimica y Minera de Chile SA  | 442 059           | 0,02              |
| 3 732 Equinix Inc  | 2 690 921        | 0,10              |  | <b>442 059</b>    | <b>0,02</b>       |
| 11 883 Equity LifeStyle Properties Inc   | 797 706          | 0,03              | <b>Peso colombien – 0,01 %</b>   |                   |                   |
| 16 072 Equity Residential  | 964 320          | 0,04              | 25 928 Bancolombia SA  | 162 380           | 0,01              |
| 3 452 Essex Property Trust Inc   | 721 951          | 0,03              |  | <b>162 380</b>    | <b>0,01</b>       |
| 6 419 Extra Space Storage Inc  | 1 045 848        | 0,04              | <b>Euro – 0,14 %</b>   |                   |                   |
| 10 900 Gaming and Leisure Properties Inc   | 567 454          | 0,02              | 1 479 Bayerische Motoren Werke AG (Non voting rights)                                      | 151 527           | 0,01              |
| 17 700 Healthcare Realty Trust Inc   | 342 141          | 0,01              | 4 911 Dr. Ing. h.c. F.Porsche AG   | 629 596           | 0,02              |
| 29 867 Healthpeak Properties Inc   | 656 178          | 0,02              | 7 139 Henkel AG & Co KGaA (Non voting rights)  | 558 909           | 0,02              |
| 32 808 Host Hotels & Resorts Inc   | 541 004          | 0,02              | 7 069 Porsche Automobil Holding SE   | 406 432           | 0,02              |
| 28 973 Invitation Homes Inc  | 904 827          | 0,03              | 2 064 Sartorius  | 867 821           | 0,03              |
| 9 841 Iron Mountain Inc  | 520 687          | 0,02              | 7 998 Volkswagen AG (Non voting rights)  | 1 091 740         | 0,04              |
| 30 100 Kimco Realty Corp   | 587 853          | 0,02              |  | <b>3 706 025</b>  | <b>0,14</b>       |
| 18 277 Medical Properties Trust Inc  | 150 237          | 0,01              | <b>Nouveau rouble russe – 0,00 %</b>   |                   |                   |
| 5 949 Mid-America Apartment Communities Inc  | 898 537          | 0,03              | 218 200 Surgutneftegas PJSC  | -                 | 0,00              |
| 40 635 Prologis Inc  | 5 070 029        | 0,19              |  | -                 | <b>0,00</b>       |
| 7 008 Public Storage   | 2 117 397        | 0,08              | <b>Won sud-coréen – 0,06 %</b>   |                   |                   |
| 26 179 Realty Income   | 1 657 654        | 0,06              | 704 Hyundai Motor Co   | 51 805            | 0,00              |
| 5 335 Regency Centers Corp   | 326 395          | 0,01              | 990 LG Chem Ltd  | 236 122           | 0,01              |
| 4 868 SBA Communications Corp  | 1 270 889        | 0,05              |  |                   |                   |
| 13 682 Simon Property Group  | 1 531 974        | 0,06              |  |                   |                   |
| 4 700 Sun Communities Inc  | 662 136          | 0,03              |  |                   |                   |

## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participations Investissements                                 | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissements                               | Juste valeur USD     | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|---|----------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)     |                  |                   | Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,60 %) (suite)  |                      |                   |
| Actions préférentielles – 0,34 % (mars 2022 : 0,39 %) (suite)  |                  |                   | Droits – Néant (mars 2022 : 0,00 %)                         |                      |                   |
| Won sud-coréen – 0,06 % (suite)                                |                  |                   | Réal brésilien – 0,00 %                                     |                      |                   |
| 33 992 Samsung Electronics Co Ltd (Non voting rights)          | 1 407 358        | 0,05              | 91 Localiza Rent a Car                                      | 236                  | 0,00              |
|  | <b>1 695 285</b> | <b>0,06</b>       | <b>Total des droits</b>                                     | <b>236</b>           | <b>0,00</b>       |
| <b>Total des actions préférentielles</b>                       | <b>8 854 783</b> | <b>0,34</b>       | <b>Total des valeurs mobilières</b>                         | <b>2 621 855 590</b> | <b>99,43</b>      |
| Instruments financiers dérivés – 0,21 % (mars 2022 : (0,01 %)) |                  |                   | Contrats de change à terme – 0,20 % (mars 2022 : (0,03 %))^ |                      |                   |

| Devise achetée | Devise vendue | Montant acheté | Montant vendu | Date d'échéance | Contrepartie                | Plus-values/<br>(Moins-values)<br>latentes<br>USD | % du Comp. |
|----------------|---------------|----------------|---------------|-----------------|-----------------------------|---|------------|
| AUD            | EUR           | 590 000        | 374 886       | 04/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (12 143)  | (0,00)     |
| CAD            | EUR           | 829 000        | 573 211       | 04/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (10 202)  | (0,00)     |
| CHF            | EUR           | 298 000        | 300 318       | 04/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (81)  | (0,00)     |
| EUR            | AUD           | 7 282 182      | 11 492 000    | 04/04/2023      | HSBC Bank                   | 214 957   | 0,01       |
| EUR            | CAD           | 11 302 010     | 16 307 000    | 04/04/2023      | HSBC Bank                   | 229 542   | 0,01       |
| EUR            | CHF           | 9 253 865      | 9 197 000     | 04/04/2023      | Merrill Lynch International | (13 459)  | (0,00)     |
| EUR            | DKK           | 2 755 375      | 20 502 000    | 04/04/2023      | HSBC Bank                   | 3 443   | 0,00       |
| EUR            | GBP           | 13 906 016     | 12 232 000    | 04/04/2023      | JP Morgan Chase Bank        | (16 067)  | (0,00)     |
| EUR            | HKD           | 2 952 448      | 24 600 000    | 04/04/2023      | HSBC Bank                   | 73 909  | 0,00       |
| EUR            | ILS           | 680 851        | 2 652 000     | 04/04/2023      | HSBC Bank                   | 3 177   | 0,00       |
| EUR            | JPY           | 19 538 675     | 2 826 240 000 | 04/04/2023      | JP Morgan Chase Bank        | (7 763)   | (0,00)     |
| EUR            | NOK           | 706 716        | 7 754 000     | 04/04/2023      | HSBC Bank                   | 27 438  | 0,00       |
| EUR            | NZD           | 56 148         | 97 000        | 04/04/2023      | HSBC Bank                   | 314   | 0,00       |
| EUR            | SEK           | 3 342 759      | 36 995 000    | 04/04/2023      | HSBC Bank                   | 64 083  | 0,00       |
| EUR            | SGD           | 1 468 284      | 2 104 000     | 04/04/2023      | HSBC Bank                   | 12 727  | 0,00       |
| EUR            | USD           | 287 337        | 305 000       | 04/04/2023      | Barclays Bank               | 7 178   | 0,00       |
| EUR            | USD           | 71 758 373     | 76 308 500    | 04/04/2023      | BNP Paribas                 | 1 653 378   | 0,06       |
| EUR            | USD           | 72 265 241     | 76 823 500    | 04/04/2023      | Westpac Banking Corporation | 1 689 064   | 0,06       |
| EUR            | USD           | 71 793 007     | 76 308 500    | 04/04/2023      | UBS AG                      | 1 691 006   | 0,06       |
| HKD            | EUR           | 3 785 000      | 454 524       | 04/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (11 648)  | (0,00)     |
| JPY            | EUR           | 70 004 000     | 485 864       | 04/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (1 877)   | (0,00)     |
| SEK            | EUR           | 2 458 000      | 222 220       | 04/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (4 391)   | (0,00)     |
| USD            | AUD           | 849 198        | 1 261 000     | 04/04/2023      | Citibank                    | 4 644   | 0,00       |
| USD            | CAD           | 1 295 344      | 1 759 000     | 04/04/2023      | HSBC Bank                   | (4 412)   | (0,00)     |
| USD            | CHF           | 1 081 460      | 1 009 000     | 04/04/2023      | UBS AG                      | (23 023)  | (0,00)     |
| USD            | DKK           | 302 108        | 2 114 000     | 04/04/2023      | Merrill Lynch International | (6 210)   | (0,00)     |
| USD            | EUR           | 7 759 303      | 7 297 506     | 04/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (169 073)   | (0,00)     |
| USD            | EUR           | 1 190 444      | 1 120 000     | 04/04/2023      | UBS AG                      | (26 380)  | (0,00)     |
| USD            | EUR           | 1 191 018      | 1 120 000     | 04/04/2023      | BNP Paribas                 | (25 806)  | (0,00)     |
| USD            | EUR           | 1 519 000      | 1 409 194     | 04/04/2023      | Barclays Bank               | (12 018)  | (0,00)     |
| USD            | GBP           | 1 616 019      | 1 337 000     | 04/04/2023      | JP Morgan Chase Bank        | (37 115)  | (0,00)     |
| USD            | GBP           | 49 664         | 41 000        | 04/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (1 030)   | (0,00)     |
| USD            | HKD           | 305 210        | 2 392 000     | 04/04/2023      | HSBC Bank                   | 494   | 0,00       |
| USD            | ILS           | 71 454         | 262 000       | 04/04/2023      | HSBC Bank                   | (1 311)   | (0,00)     |
| USD            | JPY           | 756 749        | 102 970 666   | 04/04/2023      | Barclays Bank               | (16 943)  | (0,00)     |
| USD            | JPY           | 756 770        | 102 970 668   | 04/04/2023      | UBS AG                      | (16 922)  | (0,00)     |
| USD            | JPY           | 756 815        | 102 970 666   | 04/04/2023      | JP Morgan Chase Bank        | (16 877)  | (0,00)     |
| USD            | JPY           | 23 615         | 3 202 000     | 04/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (444)   | (0,00)     |
| USD            | NOK           | 64 204         | 663 000       | 04/04/2023      | Deutsche Bank               | 899   | 0,00       |
| USD            | NZD           | 26 460         | 43 000        | 04/04/2023      | Merrill Lynch International | (443)   | (0,00)     |
| USD            | SEK           | 345 676        | 3 601 000     | 04/04/2023      | Barclays Bank               | (1 591)   | (0,00)     |
| USD            | SEK           | 29 684         | 309 000       | 04/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (115)   | (0,00)     |



## SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

Instruments financiers dérivés – 0,21 % (mars 2022 : (0,01 %)) (suite)

Contrats de change à terme – 0,20 % (mars 2022 : (0,03 %))^ (suite)

| Devise achetée | Devise vendue | Montant acheté   | Montant vendu | Date d'échéance | Contrepartie | Plus-values/<br>(Moins-values)<br>latentes<br>USD | % du<br>Comp. |
|----------------|---------------|--|---------------|-----------------|--------------|---|---------------|
| USD            | SGD           | 163 960  | 221 000       | 04/04/2023      | HSBC Bank    | (2 262)   | (0,00)        |
|                |               | Plus-values latentes sur contrats de change à terme        |               |                 |              | 5 676 253   | 0,20          |
|                |               | Moins-values latentes sur contrats de change à terme       |               |                 |              | (439 606)   | (0,00)        |
|                |               | Plus-values latentes nettes sur contrats de change à terme |               |                 |              | 5 236 647   | 0,20          |

Contrats à terme standardisés – 0,01 % (mars 2022 : 0,02 %)

| Montant notionnel | Prix du coût moyen |  | Plus-values latentes USD | % des actifs nets |
|-------------------|--------------------|--|--------------------------|-------------------|
| 6 073 023         | 2 058              | 59 of MSCI EAFE Index Futures Long Futures Contracts Expiring 16 June 2023 | 111 653                  | 0,01              |
| 2 785 780         | 3 980              | 14 of S&P 500 E-mini Index Futures Long Contracts Expiring 16 June 2023    | 110 645                  | 0,00              |
|                   |                    | Plus-values latentes nettes sur contrats à terme standardisés              | 222 298                  | 0,01              |
|                   |                    | Total des instruments financiers dérivés                                   | 5 458 945                | 0,21              |

|   | Juste valeur USD     | % du Comp.    |
|---|----------------------|---------------|
| Valeur totale des investissements   | 2 627 314 535        | 99,64         |
| Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,25 %)                                      | 4 599 695            | 0,17          |
| Liquidités détenues auprès d'un courtier* (mars 2022 : 0,00 %)                      | 217 366              | 0,01          |
| Montants à recevoir du courtier (mars 2022 : (0,01 %))                              | -                    | -             |
| Autres actifs nets (mars 2022 : 0,17 %)   | 4 723 217            | 0,18          |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>2 636 854 813</b> | <b>100,00</b> |

^ Les contrats à terme sont utilisés à des fins de couverture.

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company, à l'exception des liquidités détenues auprès d'un courtier et dues au courtier, en l'occurrence Barclays Capital.

Le courtier pour les contrats à terme standardisés ouverts est Barclays Capital.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

| Analyse du total des actifs (non auditée)                               | % du total des actifs |
|---|-----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs | 99,38                 |
| Instruments financiers dérivés négociés en Bourse                       | 0,01                  |
| Instruments financiers dérivés négociés de gré à gré                    | 0,21                  |
| Autres actifs   | 0,40                  |
| <b>Total des actifs</b>   | <b>100,00</b>         |

## SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|--|-------|----------------------|----------------------|
| <b>Actifs circulants</b>   |       |                      |                      |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                         | 1(e)  |                      |                      |
| Valeurs mobilières   |       | 1 027 666 338        | 1 136 738 517        |
| Instruments financiers dérivés   |       | 26 471               | 109 710              |
|  |       | <b>1 027 692 809</b> | <b>1 136 848 227</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie  | 1(f)  | 14 450 922           | 1 078 023            |
| Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties à des instruments financiers ouverts | 1(g)  | 909 442              | 442 643              |
| Créances :   |       |                      |                      |
| Dividendes à recevoir  |       | 2 761 623            | 3 031 585            |
| <b>Total des actifs circulants</b>   |       | <b>1 045 814 796</b> | <b>1 141 400 478</b> |
| <b>Passifs circulants</b>  |       |                      |                      |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                        | 1(e)  |                      |                      |
| Instruments financiers dérivés   |       | (5 670)              | -                    |
| Liquidités dues aux courtiers et aux contreparties pour des instruments financiers ouverts       | 1(g)  | (29 102)             | (51 427)             |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :   |       |                      |                      |
| Charges à payer  |       | (464 295)            | (524 876)            |
| À payer sur achats d'investissements   |       | (10 780 182)         | -                    |
| Provision d'impôt sur les plus-values de capital   |       | (4 715 377)          | (6 526 168)          |
| <b>Total des passifs circulants</b>  |       | <b>(15 994 626)</b>  | <b>(7 102 471)</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>              |       | <b>1 029 820 170</b> | <b>1 134 298 007</b> |
|  |       | <b>2023</b>          | <b>2022</b>          |
|  |       | <b>2021</b>          |                      |
| Valeur liquidative par action  | 5     | 68,18 USD            | 75,62 USD            |
|  |       |                      | 90,21 USD            |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|---|-------|----------------------|----------------------|
| Produits de dividendes  |       | 26 882 528           | 26 633 507           |
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 188                  | 91                   |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 9     | (124 691 382)        | (231 522 509)        |
| Produits divers   |       | 6 779                | -                    |
| <b>Total des charges d'investissement</b>   |       | <b>(97 801 887)</b>  | <b>(204 888 911)</b> |
| Charges opérationnelles   | 3     | (5 519 405)          | (7 393 318)          |
| <b>Perte nette pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(103 321 292)</b> | <b>(212 282 229)</b> |
| <b>Charges financières</b>  |       |                      |                      |
| Charges d'intérêts  |       | -                    | (11 895)             |
| <b>Perte pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(103 321 292)</b> | <b>(212 294 124)</b> |
| Impôt sur les plus-values de capital  | 2     | (4 828 162)          | (6 869 282)          |
| Retenue à la source sur produits d'investissement   | 2     | (3 803 096)          | (3 323 474)          |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(111 952 550)</b> | <b>(222 486 880)</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|---|----------------------|----------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier               | 1 134 298 007        | 1 490 232 394        |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(111 952 550)</b> | <b>(222 486 880)</b> |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                      |                      |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 24 601 887           | 14 761 737           |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (17 127 174)         | (148 209 244)        |
| Augmentation/(Diminution) des actifs nets résultant d'opérations sur actions  | 7 474 713            | (133 447 507)        |
| <b>Diminution totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                   | <b>(104 477 837)</b> | <b>(355 934 387)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>        | <b>1 029 820 170</b> | <b>1 134 298 007</b> |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|---|-------|----------------------|----------------------|
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(111 952 550)</b> | <b>(222 486 880)</b> |
| <b>Ajustement pour :</b>  |       |                      |                      |
| Variation de la trésorerie détenue par/à payer au courtier  |       | (489 124)            | 474 847              |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  |       | 119 852 361          | 348 498 292          |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés   |       | 88 909               | (77 038)             |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   |       | <b>7 499 596</b>     | <b>126 409 221</b>   |
| Variation des montants à recevoir   |       | 269 962              | 999 312              |
| Variation des montants à payer  |       | (1 871 372)          | 6 342 876            |
| <b>Sorties de trésorerie sur opérations</b>   |       | <b>(1 601 410)</b>   | <b>7 342 188</b>     |
| <b>Sorties de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  |       | <b>5 898 186</b>     | <b>133 751 409</b>   |
| <b>Activités de financement</b>   |       |                      |                      |
| Produits des souscriptions  | 5     | 24 601 887           | 14 761 737           |
| Paiements sur rachats   | 5     | (17 127 174)         | (148 209 244)        |
| <b>Trésorerie nette générée/(utilisée) sur activités de financement</b>   |       | <b>7 474 713</b>     | <b>(133 447 507)</b> |
| <b>Augmentation nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>   |       | <b>13 372 899</b>    | <b>303 902</b>       |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  |       | 1 078 023            | 774 121              |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   |       | <b>14 450 922</b>    | <b>1 078 023</b>     |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |       |                      |                      |
| Impôts payés  |       | (3 915 881)          | (3 666 588)          |
| Intérêts reçus  |       | 188                  | 57                   |
| Intérêts payés  |       | -                    | (11 895)             |
| Dividendes reçus  |       | 27 152 490           | 27 632 819           |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation | Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation | Investissement  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---------------|--|------------------|-------------------|---------------|---|------------------|-------------------|
|               | <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %)</b> |                  |                   |               | <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %)</b>        |                  |                   |
|               | <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %)</b>  |                  |                   |               | <b>(suite)</b>  |                  |                   |
|               | <b>Dollar de Hong Kong – 31,15 %</b>                       |                  |                   |               | <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 % (suite))</b> |                  |                   |
|               |  |                  |                   |               | <b>Dollar de Hong Kong – 31,15 % (suite)</b>                      |                  |                   |
|               | 379 300 3SBio Inc  | 377 853          | 0,04              |               | 226 000 China Lesso Group Holdings Ltd                            | 202 106          | 0,02              |
|               | 177 500 AAC Technologies Holdings Inc                      | 437 761          | 0,04              |               | 1 484 945 China Life Insurance Co Ltd                             | 2 440 244        | 0,24              |
|               | 5 769 000 Agricultural Bank of China Ltd                   | 2 138 586        | 0,21              |               | 69 000 China Literature Ltd                                       | 355 990          | 0,03              |
|               | 354 000 Air China Ltd                                      | 316 573          | 0,03              |               | 727 000 China Longyuan Power Group Corp Ltd                       | 830 730          | 0,08              |
|               | 99 000 Akeso Inc   | 509 506          | 0,05              |               | 241 400 China Medical System Holdings Ltd                         | 381 322          | 0,04              |
|               | 2 942 992 Alibaba Group Holding Ltd                        | 37 640 545       | 3,65              |               | 114 000 China Meidong Auto Holdings Ltd                           | 246 009          | 0,02              |
|               | 848 000 Alibaba Health Information Technology Ltd          | 613 589          | 0,06              |               | 641 000 China Mengniu Dairy Co Ltd                                | 2 629 342        | 0,25              |
|               | 788 000 Aluminum Corp of China Ltd                         | 399 524          | 0,04              |               | 759 213 China Merchants Bank Co Ltd                               | 3 878 297        | 0,38              |
|               | 227 500 Anhui Conch Cement Co Ltd                          | 788 285          | 0,08              |               | 275 196 China Merchants Port Holdings Co Ltd                      | 422 087          | 0,04              |
|               | 19 200 Anhui Gujing Distillery Co Ltd                      | 342 667          | 0,03              |               | 1 149 580 China Minsheng Banking Corp Ltd                         | 393 935          | 0,04              |
|               | 240 400 ANTA Sports Products Ltd                           | 3 491 181        | 0,34              |               | 894 000 China National Building Material Co Ltd                   | 733 426          | 0,07              |
|               | 519 000 AviChina Industry & Technology Co Ltd              | 272 394          | 0,03              |               | 472 000 China Oilfield Services Ltd                               | 484 029          | 0,05              |
|               | 445 330 Baidu Inc  | 8 435 795        | 0,82              |               | 750 853 China Overseas Land & Investment                          | 1 813 537        | 0,18              |
|               | 15 788 000 Bank of China Ltd                               | 6 053 781        | 0,59              |               | 260 000 China Overseas Property Holdings Ltd                      | 317 633          | 0,03              |
|               | 1 736 800 Bank of Communications Co Ltd                    | 1 092 974        | 0,11              |               | 550 600 China Pacific Insurance Group Co Ltd                      | 1 462 431        | 0,14              |
|               | 120 588 BeiGene Ltd  | 1 987 794        | 0,19              |               | 546 000 China Petroleum & Chemical Corp                           | 322 733          | 0,03              |
|               | 390 000 Beijing Capital International Airport Co Ltd       | 287 161          | 0,03              |               | 845 000 China Power International Development Ltd                 | 335 849          | 0,03              |
|               | 44 500 Beijing Enterprises Holdings Ltd                    | 160 144          | 0,02              |               | 830 000 China Railway Group Ltd (Class H)                         | 506 462          | 0,05              |
|               | 824 000 Beijing Enterprises Water Group Ltd                | 205 739          | 0,02              |               | 339 402 China Resources Beer Holdings Co Ltd                      | 2 723 880        | 0,26              |
|               | 34 298 Bilibili Inc  | 828 400          | 0,08              |               | 575 458 China Resources Cement Holdings Ltd                       | 282 233          | 0,03              |
|               | 53 400 BOC Aviation Ltd                                    | 412 577          | 0,04              |               | 205 600 China Resources Gas Group Ltd                             | 758 237          | 0,07              |
|               | 618 000 Bosideng International Holdings Ltd                | 344 823          | 0,03              |               | 650 000 China Resources Land Ltd                                  | 2 964 350        | 0,29              |
|               | 164 500 BYD Co Ltd (Class H)                               | 4 815 585        | 0,47              |               | 135 600 China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd               | 712 552          | 0,07              |
|               | 122 500 BYD Electronic International Co Ltd                | 380 767          | 0,04              |               | 303 500 China Resources Pharmaceutical Group Ltd                  | 240 482          | 0,02              |
|               | 79 000 C&D International Investment Group Ltd              | 259 142          | 0,02              |               | 435 023 China Resources Power Holdings Co Ltd                     | 926 577          | 0,09              |
|               | 2 502 200 CGN Power Co Ltd                                 | 599 257          | 0,06              |               | 864 000 China Ruyi Holdings Ltd                                   | 225 632          | 0,02              |
|               | 1 622 800 China Cinda Asset Management Co Ltd              | 204 660          | 0,02              |               | 724 500 China Shenhua Energy Co Ltd                               | 2 279 651        | 0,22              |
|               | 1 288 200 China CITIC Bank Corp Ltd                        | 648 207          | 0,06              |               | 258 000 China Southern Airlines Co Ltd                            | 184 052          | 0,02              |
|               | 423 000 China Coal Energy Co Ltd                           | 320 620          | 0,03              |               | 482 000 China State Construction International Holdings Ltd       | 545 247          | 0,05              |
|               | 1 086 800 China Com Rich Rene Ene Invest                   | -                | 0,00              |               | 293 262 China Taiping Insurance Holdings Co Ltd                   | 311 569          | 0,03              |
|               | 608 367 China Communications Services Corp Ltd             | 299 148          | 0,03              |               | 8 600 China Tourism Group Duty Free Corp Ltd                      | 212 646          | 0,02              |
|               | 345 500 China Conch Venture Holdings Ltd                   | 602 978          | 0,06              |               | 8 178 000 China Tower Corp Ltd                                    | 989 701          | 0,10              |
|               | 19 084 000 China Construction Bank Corp                    | 12 374 290       | 1,20              |               | 490 000 China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd        | 256 549          | 0,02              |
|               | 629 000 China Everbright Bank Co Ltd                       | 190 704          | 0,02              |               | 305 408 China Vanke Co Ltd  | 481 653          | 0,05              |
|               | 940 851 China Everbright Environment Group Ltd             | 403 909          | 0,04              |               | 532 000 Chinasoft International Ltd                               | 336 823          | 0,03              |
|               | 397 300 China Evergrande Group                             | 20 877           | 0,00              |               | 394 000 Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd                         | 781 982          | 0,08              |
|               | 681 000 China Feihe Ltd                                    | 510 970          | 0,05              |               | 1 153 000 CITIC Ltd   | 1 348 358        | 0,13              |
|               | 659 200 China Galaxy Securities Co Ltd                     | 331 701          | 0,03              |               | 370 250 CITIC Securities Co Ltd                                   | 790 501          | 0,08              |
|               | 624 400 China Gas Holdings Ltd                             | 879 733          | 0,09              |               |   |                  |                   |
|               | 360 000 China Hongqiao Group Ltd                           | 344 868          | 0,03              |               |   |                  |                   |
|               | 298 000 China International Capital Corp Ltd               | 597 522          | 0,06              |               |   |                  |                   |
|               | 1 380 751 China Jinmao Holdings Group Ltd                  | 269 116          | 0,03              |               |   |                  |                   |

## SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                       | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                       | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %) (suite)</b>  |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Dollar de Hong Kong – 31,15 % (suite)</b>                       |                  |                   | <b>Dollar de Hong Kong – 31,15 % (suite)</b>                       |                  |                   |
| 621 000 CMOG Group Ltd   | 375 767          | 0,04              | 342 000 Jiangxi Copper Co Ltd                                      | 579 443          | 0,06              |
| 623 700 COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd                             | 701 568          | 0,07              | 139 000 Jiumaojiu International Holdings Ltd                       | 330 769          | 0,03              |
| 506 583 COSCO SHIPPING Ports Ltd                                   | 338 154          | 0,03              | 138 000 Kingboard Holdings Ltd                                     | 423 671          | 0,04              |
| 2 440 119 Country Garden Holdings Co Ltd                           | 686 968          | 0,07              | 250 000 Kingboard Laminates Holdings Ltd                           | 261 148          | 0,02              |
| 422 197 Country Garden Services Holdings Co Ltd                    | 730 379          | 0,07              | 521 000 Kingdee International Software Group Co Ltd                | 844 224          | 0,08              |
| 899 000 CRRG Corp Ltd  | 490 159          | 0,05              | 206 400 Kingsoft Corp Ltd  | 1 016 231        | 0,10              |
| 1 836 560 CSPC Pharmaceutical Group                                | 1 806 157        | 0,18              | 77 000 Koolearn Technology Holding Ltd                             | 332 034          | 0,03              |
| 246 000 Dongfeng Motor Group Co Ltd                                | 115 323          | 0,01              | 342 700 Kuaishou Technology  | 2 639 025        | 0,26              |
| 307 000 Dongyue Group Ltd  | 316 779          | 0,03              | 854 000 Kunlun Energy Co Ltd                                       | 667 974          | 0,06              |
| 162 100 ENN Energy Holdings Ltd                                    | 2 221 920        | 0,22              | 1 506 000 Lenovo Group Ltd   | 1 630 711        | 0,16              |
| 336 000 Far East Horizon Ltd                                       | 302 188          | 0,03              | 221 466 Li Auto Inc  | 2 764 816        | 0,27              |
| 106 000 Flat Glass Group Co Ltd                                    | 303 824          | 0,03              | 467 500 Li Ning Co Ltd   | 3 686 425        | 0,36              |
| 452 480 Fosun International Ltd                                    | 332 013          | 0,03              | 345 000 Longfor Group Holdings Ltd                                 | 973 478          | 0,09              |
| 113 200 Fuyao Glass Industry Group Co Ltd                          | 493 180          | 0,05              | 1 003 480 Meituan  | 18 343 987       | 1,78              |
| 75 160 Ganfeng Lithium Group Co Ltd                                | 467 240          | 0,04              | 131 436 Microport Scientific Corp                                  | 309 086          | 0,03              |
| 4 031 000 GCL Technology Holdings Ltd                              | 1 042 418        | 0,10              | 142 000 Minth Group Ltd  | 428 716          | 0,04              |
| 154 200 GDS Holdings Ltd   | 373 225          | 0,04              | 390 875 NetEase Inc  | 6 871 477        | 0,67              |
| 1 192 000 Geely Automobile Holdings Ltd                            | 1 533 666        | 0,15              | 198 800 New China Life Insurance Co Ltd                            | 472 565          | 0,05              |
| 246 000 Genscript Biotech Corp                                     | 526 475          | 0,05              | 301 950 New Oriental Education & Technology Group Inc              | 1 177 035        | 0,11              |
| 196 400 GF Securities Co Ltd                                       | 278 214          | 0,03              | 416 000 Nine Dragons Paper Holdings Ltd                            | 311 605          | 0,03              |
| 643 500 Great Wall Motor Co Ltd                                    | 794 338          | 0,08              | 357 000 Nongfu Spring Co Ltd                                       | 2 053 332        | 0,20              |
| 174 000 Greentown China Holdings Ltd                               | 225 647          | 0,02              | 25 500 Orient Overseas International Ltd                           | 487 914          | 0,05              |
| 338 000 Greentown Service Group Co Ltd                             | 213 566          | 0,02              | 1 301 000 People's Insurance Co Group of China Ltd                 | 434 222          | 0,04              |
| 600 000 Guangdong Investment Ltd                                   | 613 762          | 0,06              | 4 315 900 PetroChina Co Ltd  | 2 556 568        | 0,25              |
| 652 400 Guangzhou Automobile Group Co Ltd                          | 411 389          | 0,04              | 52 900 Phamaron Beijing Co Ltd                                     | 222 047          | 0,02              |
| 228 000 Haidilao International Holding Ltd                         | 617 201          | 0,06              | 1 437 307 PICC Property & Casualty Co Ltd                          | 1 466 612        | 0,14              |
| 434 400 Haier Smart Home Co Ltd                                    | 1 366 847        | 0,13              | 88 800 Ping An Healthcare and Technology Co Ltd                    | 224 660          | 0,02              |
| 185 000 Haitian International Holdings Ltd                         | 478 411          | 0,05              | 1 242 000 Ping An Insurance Group Co of China Ltd                  | 8 084 918        | 0,78              |
| 678 800 Haitong Securities Co Ltd                                  | 423 712          | 0,04              | 91 600 Pop Mart International Group Ltd                            | 249 714          | 0,02              |
| 23 900 Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd                         | 224 387          | 0,02              | 1 468 000 Postal Savings Bank of China Co Ltd                      | 871 455          | 0,08              |
| 238 385 Hansoh Pharmaceutical Group Co Ltd                         | 414 216          | 0,04              | 312 000 Sany Heavy Equipment International Holdings Co Ltd         | 324 721          | 0,03              |
| 139 500 Hengan International Group Co Ltd                          | 645 081          | 0,06              | 89 000 Shandong Gold Mining Co Ltd                                 | 180 722          | 0,02              |
| 152 000 Hua Hong Semiconductor Ltd                                 | 672 870          | 0,06              | 477 200 Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd               | 762 309          | 0,07              |
| 396 000 Huaneng Power International Inc                            | 207 838          | 0,02              | 128 500 Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd                 | 365 041          | 0,04              |
| 430 000 Huatai Securities Co Ltd                                   | 491 353          | 0,05              | 48 000 Shanghai Fudan Microelectronics Group Co Ltd                | 176 409          | 0,02              |
| 510 000 Huishan Dairy  | -                | 0,00              | 163 500 Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd                    | 304 924          | 0,03              |
| 58 200 Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd                           | 413 705          | 0,04              |  |                  |                   |
| 11 199 000 Industrial & Commercial Bank of China Ltd               | 5 963 327        | 0,58              |  |                  |                   |
| 246 000 Innovent Biologics Inc                                     | 1 101 523        | 0,11              |  |                  |                   |
| 212 672 JD Health International Inc                                | 1 582 181        | 0,15              |  |                  |                   |
| 433 463 JD.com Inc   | 9 497 594        | 0,92              |  |                  |                   |
| 366 000 Jiangu Expressway Co Ltd                                   | 341 291          | 0,03              |  |                  |                   |

## SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                       | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|--|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %) (suite)</b>  |                    |                   |
| <b>Dollar de Hong Kong – 31,15 % (suite)</b>                       |                    |                   |
| 447 256 Shenzhen International Holdings Ltd                        | 395 411            | 0,04              |
| 173 400 Shenzhen International Group Holdings Ltd                  | 1 820 159          | 0,18              |
| 311 000 Shimao Group Holdings Ltd                                  | 43 778             | 0,00              |
| 2 246 750 Sino Biopharmaceutical Ltd                               | 1 259 333          | 0,12              |
| 184 000 Sinopharm Group Co Ltd                                     | 556 691            | 0,05              |
| 366 000 Smoore International Holdings Ltd                          | 469 975            | 0,05              |
| 600 300 Sunac China Holdings Ltd                                   | 87 560             | 0,01              |
| 149 500 Sunny Optical Technology Group Co Ltd                      | 1 808 295          | 0,18              |
| 1 239 600 Tencent Holdings Ltd                                     | 60 922 385         | 5,92              |
| 430 000 Tingyi Cayman Islands Holding Corp                         | 716 489            | 0,07              |
| 202 400 Tongcheng Travel Holdings Ltd                              | 440 384            | 0,04              |
| 309 000 Topsports International Holdings Ltd                       | 282 629            | 0,03              |
| 199 000 TravelSky Technology Ltd                                   | 371 638            | 0,04              |
| 122 000 Tsingtao Brewery Co Ltd                                    | 1 331 907          | 0,13              |
| 359 429 Uni-President China Holdings Ltd                           | 362 636            | 0,03              |
| 80 000 Vinda International Holdings Ltd                            | 193 428            | 0,02              |
| 857 000 Want Want China Holdings Ltd                               | 551 322            | 0,05              |
| 393 600 Weichai Power Co Ltd                                       | 631 770            | 0,06              |
| 68 932 WuXi AppTec Co Ltd  | 721 815            | 0,07              |
| 708 811 Wuxi Biologics Cayman Inc                                  | 4 388 336          | 0,43              |
| 3 021 200 Xiaomi Corp  | 4 656 911          | 0,45              |
| 1 027 102 Xinyi Solar Holdings Ltd                                 | 1 231 222          | 0,12              |
| 179 986 XPeng Inc  | 1 003 113          | 0,10              |
| 210 500 Xtep International Holdings Ltd                            | 267 618            | 0,03              |
| 254 000 Yadea Group Holdings Ltd                                   | 655 227            | 0,06              |
| 278 000 Yankuang Energy Group Co Ltd                               | 995 140            | 0,10              |
| 103 000 Yihai International Holding Ltd                            | 302 441            | 0,03              |
| 280 800 Yuexiu Property Co Ltd                                     | 423 528            | 0,04              |
| 292 500 Zhaojin Mining Industry Co Ltd                             | 444 156            | 0,04              |
| 376 000 Zhejiang Expressway Co Ltd                                 | 298 886            | 0,03              |
| 140 500 ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd                        | 442 980            | 0,04              |
| 124 500 Zhongsheng Group Holdings Ltd                              | 613 781            | 0,06              |
| 111 300 Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd                         | 484 193            | 0,05              |
| 1 153 000 Zijin Mining Group Co Ltd                                | 1 927 064          | 0,19              |
| 131 160 ZTE Corp (Class H)   | 384 293            | 0,04              |
|  | <b>320 752 881</b> | <b>31,15</b>      |
| <b>Roupie indienne – 16,24 %</b>                                   |                    |                   |
| 4 977 ABB India Ltd  | 203 795            | 0,02              |
| 15 608 ACC Ltd   | 316 633            | 0,03              |
| 35 354 Adani Enterprises Ltd                                       | 753 024            | 0,07              |
| 63 987 Adani Green Energy Ltd                                      | 686 060            | 0,07              |
| 95 268 Adani Ports & Special Economic Zone Ltd                     | 732 514            | 0,07              |

| Participation Investissement                                       | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Roupie indienne – 16,24 % (suite)</b>                           |                  |                   |
| 174 551 Adani Power Ltd  | 406 948          | 0,04              |
| 54 839 Adani Total Gas Ltd   | 579 035          | 0,06              |
| 56 854 Adani Transmission Ltd                                      | 686 994          | 0,07              |
| 125 493 Ambuja Cements Ltd   | 558 196          | 0,05              |
| 19 423 Apollo Hospitals Enterprise Ltd                             | 1 018 837        | 0,10              |
| 78 322 Asian Paints Ltd  | 2 631 922        | 0,26              |
| 24 528 AU Small Finance Bank Ltd                                   | 172 867          | 0,02              |
| 32 828 Avenue Supermarts Ltd                                       | 1 358 558        | 0,13              |
| 436 611 Axis Bank Ltd  | 4 560 953        | 0,44              |
| 9 799 Bajaj Auto Ltd   | 463 197          | 0,04              |
| 55 001 Bajaj Finance Ltd   | 3 759 035        | 0,36              |
| 77 432 Bajaj Finserv Ltd   | 1 193 291        | 0,12              |
| 2 385 Bajaj Holdings & Investment Ltd                              | 171 806          | 0,02              |
| 18 387 Balkrishna Industries Ltd                                   | 436 605          | 0,04              |
| 152 071 Bandhan Bank Ltd   | 362 217          | 0,04              |
| 189 387 Bank of Baroda   | 389 110          | 0,04              |
| 50 005 Berger Paints India Ltd                                     | 353 943          | 0,03              |
| 834 023 Bharat Electronics Ltd                                     | 989 979          | 0,10              |
| 39 765 Bharat Forge Ltd  | 372 792          | 0,04              |
| 179 464 Bharat Petroleum Corp Ltd                                  | 751 857          | 0,07              |
| 427 536 Bharti Airtel Ltd  | 3 896 504        | 0,38              |
| 19 933 Britannia Industries Ltd                                    | 1 048 318        | 0,10              |
| 118 127 CG Power & Industrial Solutions Ltd                        | 431 284          | 0,04              |
| 81 504 Cholamandalam Investment and Finance Co Ltd                 | 755 015          | 0,07              |
| 108 059 Cipla Ltd/India  | 1 184 037        | 0,11              |
| 255 822 Coal India Ltd   | 665 061          | 0,06              |
| 26 172 Colgate-Palmolive India Ltd                                 | 480 034          | 0,05              |
| 46 638 Container Corp Of India Ltd                                 | 329 288          | 0,03              |
| 147 077 Dabur India Ltd  | 975 174          | 0,09              |
| 25 696 Divi's Laboratories Ltd                                     | 882 777          | 0,09              |
| 125 181 DLF Ltd  | 543 328          | 0,05              |
| 22 701 Dr Reddy's Laboratories Ltd                                 | 1 276 927        | 0,12              |
| 27 273 Eicher Motors Ltd   | 978 602          | 0,10              |
| 359 104 GAIL India Ltd   | 459 463          | 0,04              |
| 74 517 Godrej Consumer Products Ltd                                | 877 847          | 0,09              |
| 18 052 Godrej Properties Ltd                                       | 226 478          | 0,02              |
| 62 509 Grasim Industries Ltd                                       | 1 241 851        | 0,12              |
| 53 659 Havells India Ltd   | 776 001          | 0,08              |
| 175 589 HCL Technologies Ltd                                       | 2 318 717        | 0,23              |
| 164 587 HDFC Life Insurance Co Ltd                                 | 999 748          | 0,10              |
| 23 063 Hero MotoCorp Ltd   | 658 740          | 0,06              |
| 278 261 Hindalco Industries Ltd                                    | 1 372 471        | 0,13              |
| 160 708 Hindustan Petroleum Corp Ltd                               | 463 063          | 0,04              |



## SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                       | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Roupie indienne – 16,24 % (suite)</b>                           |                  |                   |
| 160 937 Hindustan Unilever Ltd                                     | 5 013 903        | 0,49              |
| 335 787 Housing Development Finance Corp Ltd                       | 10 727 451       | 1,04              |
| 1 010 496 ICICI Bank Ltd   | 10 786 452       | 1,05              |
| 44 837 ICICI Lombard General Insurance Co Ltd                      | 583 496          | 0,06              |
| 83 660 ICICI Prudential Life Insurance Co Ltd                      | 443 533          | 0,04              |
| 165 825 Indian Hotels Co Ltd                                       | 654 462          | 0,06              |
| 337 839 Indian Oil Corp Ltd  | 320 234          | 0,03              |
| 41 641 Indian Railway Catering & Tourism Corp Ltd                  | 290 232          | 0,03              |
| 65 344 Indraprastha Gas Ltd  | 340 863          | 0,03              |
| 143 118 Indus Towers Ltd   | 249 030          | 0,02              |
| 15 073 Info Edge India Ltd   | 682 932          | 0,07              |
| 668 187 Infosys Ltd  | 11 609 985       | 1,13              |
| 18 096 InterGlobe Aviation Ltd                                     | 420 711          | 0,04              |
| 584 800 ITC Ltd  | 2 728 936        | 0,26              |
| 62 349 Jindal Steel & Power Ltd                                    | 414 383          | 0,04              |
| 141 715 JSW Steel Ltd  | 1 186 555        | 0,12              |
| 68 998 Jubilant Foodworks Ltd                                      | 369 495          | 0,04              |
| 106 353 Kotak Mahindra Bank Ltd                                    | 2 242 494        | 0,22              |
| 134 800 Larsen & Toubro Ltd  | 3 549 833        | 0,34              |
| 20 170 LTIMindtree Ltd   | 1 168 158        | 0,11              |
| 52 211 Lupin Ltd   | 411 932          | 0,04              |
| 181 908 Mahindra & Mahindra  | 2 564 741        | 0,25              |
| 107 090 Marico Ltd   | 625 216          | 0,06              |
| 24 111 Maruti Suzuki India Ltd                                     | 2 432 781        | 0,24              |
| 10 362 Mphasis Ltd   | 226 418          | 0,02              |
| 514 MRF Ltd  | 525 662          | 0,05              |
| 28 421 Muthoot Finance Ltd   | 338 894          | 0,03              |
| 5 857 Nestle India Ltd   | 1 404 304        | 0,14              |
| 827 543 NTPC Ltd   | 1 763 183        | 0,17              |
| 537 197 Oil & Natural Gas Corp Ltd                                 | 987 359          | 0,10              |
| 1 313 Page Industries Ltd  | 605 567          | 0,06              |
| 138 573 Petronet LNG Ltd   | 385 878          | 0,04              |
| 18 453 PI Industries Ltd   | 680 392          | 0,07              |
| 27 826 Pidilite Industries Ltd                                     | 796 697          | 0,08              |
| 601 384 Power Grid Corp of India Ltd                               | 1 651 597        | 0,16              |
| 596 897 Reliance Industries Ltd                                    | 16 930 572       | 1,64              |
| 374 480 Samvardhana Motherson International Ltd                    | 305 754          | 0,03              |
| 29 723 SBI Cards & Payment Services Ltd                            | 267 709          | 0,03              |
| 87 264 SBI Life Insurance Co Ltd                                   | 1 169 183        | 0,11              |
| 1 554 Shree Cement Ltd   | 495 173          | 0,05              |
| 40 034 Shriram Finance Ltd   | 613 498          | 0,06              |

| Participation Investissement                                       | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|--|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %) (suite)</b>  |                    |                   |
| <b>Roupie indienne – 16,24 % (suite)</b>                           |                    |                   |
| 14 681 Siemens Ltd   | 594 359            | 0,06              |
| 31 578 SRF Ltd   | 926 735            | 0,09              |
| 357 965 State Bank of India  | 2 281 315          | 0,22              |
| 198 060 Sun Pharmaceutical Industries Ltd                          | 2 369 273          | 0,23              |
| 181 619 Tata Consultancy Services Ltd                              | 7 084 870          | 0,69              |
| 92 867 Tata Consumer Products Ltd                                  | 801 007            | 0,08              |
| 7 736 Tata Elxsi Ltd   | 560 942            | 0,05              |
| 340 966 Tata Motors Ltd  | 1 745 852          | 0,17              |
| 246 446 Tata Power Co Ltd  | 570 515            | 0,06              |
| 1 377 278 Tata Steel Ltd   | 1 751 292          | 0,17              |
| 127 736 Tech Mahindra Ltd  | 1 712 602          | 0,17              |
| 75 920 Titan Co Ltd  | 2 323 259          | 0,23              |
| 23 177 Torrent Pharmaceuticals Ltd                                 | 433 505            | 0,04              |
| 41 982 Trent Ltd   | 702 378            | 0,07              |
| 14 584 Tube Investments of India Ltd                               | 451 916            | 0,04              |
| 41 327 TVS Motor Co Ltd  | 541 690            | 0,05              |
| 21 924 UltraTech Cement Ltd  | 2 033 377          | 0,20              |
| 60 362 United Spirits Ltd  | 555 493            | 0,05              |
| 104 879 UPL Ltd  | 915 845            | 0,09              |
| 44 271 Varun Beverages Ltd   | 747 165            | 0,07              |
| 136 244 Vedanta Ltd  | 454 989            | 0,04              |
| 271 002 Wipro Ltd  | 1 204 435          | 0,12              |
| 2 381 221 Yes Bank Ltd   | 436 071            | 0,04              |
| 450 014 Zomato Ltd   | 279 265            | 0,03              |
|  | <b>167 194 694</b> | <b>16,24</b>      |
| <b>Roupie indonésienne – 2,17 %</b>                                |                    |                   |
| 2 648 500 Adaro Energy Indonesia Tbk PT                            | 512 231            | 0,05              |
| 1 804 200 Aneka Tambang Tbk  | 251 477            | 0,02              |
| 3 911 600 Astra International Tbk PT                               | 1 565 214          | 0,15              |
| 11 103 200 Bank Central Asia Tbk PT                                | 6 479 242          | 0,63              |
| 3 666 300 Bank Mandiri Persero Tbk PT                              | 2 524 562          | 0,24              |
| 1 254 800 Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT                     | 782 446            | 0,08              |
| 13 875 794 Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT                    | 4 377 105          | 0,42              |
| 7 340 083 Barito Pacific Tbk PT                                    | 403 853            | 0,04              |
| 1 415 900 Charoen Pokphand Indonesia Tbk PT                        | 471 196            | 0,05              |
| 525 900 Indah Kiat Pulp & Paper Tbk PT                             | 263 046            | 0,03              |
| 290 498 Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT                          | 193 252            | 0,02              |
| 1 272 800 Indofood Sukses Makmur Tbk PT                            | 526 284            | 0,05              |
| 4 892 100 Kalbe Farma Tbk PT                                       | 685 145            | 0,07              |
| 1 970 257 Merdeka Copper Gold Tbk PT                               | 550 560            | 0,05              |
| 1 593 500 Sarana Menara Nusantara Tbk PT                           | 98 302             | 0,01              |
| 751 816 Semen Indonesia Persero Tbk PT                             | 315 879            | 0,03              |
| 4 079 900 Sumber Alfaria Trijaya Tbk PT                            | 783 628            | 0,08              |

## SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                       | Juste valeur USD  | % des actifs nets | Participation Investissement                                       | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|-------------------|-------------------|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b> |                   |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %) (suite)</b>  |                   |                   | <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Roupie indonésienne – 2,17 % (suite)</b>                        |                   |                   | <b>Nouveau dollar de Taïwan – 18,82 % (suite)</b>                  |                  |                   |
| 1 738 500 Unilever Indonesia Tbk PT                                | 504 350           | 0,05              | 23 021 Airtac International Group                                  | 895 965          | 0,09              |
| 413 800 United Tractors Tbk PT                                     | 803 067           | 0,08              | 694 029 ASE Technology Holding Co Ltd                              | 2 564 357        | 0,25              |
| 546 400 Vale Indonesia Tbk PT                                      | 242 326           | 0,02              | 470 904 Asia Cement Corp   | 669 682          | 0,06              |
|  | <b>22 333 165</b> | <b>2,17</b>       | 146 980 Asustek Computer Inc                                       | 1 315 446        | 0,13              |
| <b>Ringgit malais – 1,83 %</b>                                     |                   |                   | 368 000 AUO Corp   | 222 389          | 0,02              |
| 563 400 AMMB Holdings Bhd  | 478 810           | 0,05              | 131 000 Catcher Technology Co Ltd                                  | 817 473          | 0,08              |
| 485 712 Axiata Group Bhd   | 331 330           | 0,03              | 1 673 780 Cathay Financial Holding Co Ltd                          | 2 297 857        | 0,22              |
| 1 284 778 CIMB Group Holdings Bhd                                  | 1 546 101         | 0,15              | 256 321 Chailease Holding Co Ltd                                   | 1 881 525        | 0,18              |
| 1 006 878 Dialog Group Bhd   | 538 523           | 0,05              | 817 318 Chang Hwa Commercial Bank Ltd                              | 465 735          | 0,05              |
| 823 000 DiGi.Com Bhd   | 809 478           | 0,08              | 382 257 Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd                          | 458 872          | 0,04              |
| 358 000 Gamuda Bhd   | 331 023           | 0,03              | 440 000 China Airlines Ltd   | 281 797          | 0,03              |
| 374 000 Genting Bhd  | 394 978           | 0,04              | 3 085 997 China Development Financial Holding Corp                 | 1 272 001        | 0,12              |
| 752 300 Genting Malaysia Bhd                                       | 451 806           | 0,04              | 2 462 272 China Steel Corp   | 2 498 865        | 0,24              |
| 80 000 HAP Seng Consolidated Bhd                                   | 92 465            | 0,01              | 741 000 Chunghwa Telecom Co Ltd                                    | 2 908 268        | 0,28              |
| 130 558 Hong Leong Bank Bhd  | 598 274           | 0,06              | 845 000 Compal Electronics Inc                                     | 700 755          | 0,07              |
| 303 900 IHH Healthcare Bhd   | 396 017           | 0,04              | 3 657 601 CTBC Financial Holding Co Ltd                            | 2 624 800        | 0,25              |
| 280 100 Inari Amertron Bhd   | 156 158           | 0,02              | 405 456 Delta Electronics Inc                                      | 4 008 285        | 0,39              |
| 652 000 IOI Corp Bhd   | 562 973           | 0,05              | 173 000 E Ink Holdings Inc   | 1 048 313        | 0,10              |
| 64 870 Kuala Lumpur Kepong Bhd                                     | 305 495           | 0,03              | 2 635 846 E.Sun Financial Holding Co Ltd                           | 2 190 226        | 0,21              |
| 856 666 Malayan Banking Bhd  | 1 663 825         | 0,16              | 34 898 Eclat Textile Co Ltd  | 567 354          | 0,06              |
| 172 237 Malaysia Airports Holdings Bhd                             | 265 040           | 0,03              | 12 000 eMemory Technology Inc                                      | 733 065          | 0,07              |
| 669 700 Maxis Bhd  | 626 824           | 0,06              | 429 000 Eva Airways Corp   | 378 312          | 0,04              |
| 223 852 MISC Bhd   | 366 280           | 0,04              | 212 018 Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd                           | 1 103 698        | 0,11              |
| 391 950 MR DIY Group M Bhd   | 137 682           | 0,01              | 551 714 Far Eastern New Century Corp                               | 567 161          | 0,05              |
| 9 500 Nestle Malaysia Bhd  | 295 173           | 0,03              | 367 000 Far Eastone Telecommunications Co Ltd                      | 906 426          | 0,09              |
| 498 800 Petronas Chemicals Group Bhd                               | 799 210           | 0,08              | 59 403 Feng TAY Enterprise Co Ltd                                  | 376 543          | 0,04              |
| 70 900 Petronas Dagangan Bhd                                       | 342 891           | 0,03              | 2 142 854 First Financial Holding Co Ltd                           | 1 861 515        | 0,18              |
| 147 400 Petronas Gas Bhd   | 550 516           | 0,05              | 683 760 Formosa Chemicals & Fibre Corp                             | 1 551 780        | 0,15              |
| 112 300 PPB Group Bhd  | 421 459           | 0,04              | 206 000 Formosa Petrochemical Corp                                 | 575 088          | 0,06              |
| 725 700 Press Metal Aluminium Holdings Bhd                         | 800 943           | 0,08              | 809 400 Formosa Plastics Corp                                      | 2 440 362        | 0,24              |
| 2 927 750 Public Bank Bhd  | 2 654 051         | 0,26              | 1 458 505 Fubon Financial Holding Co Ltd                           | 2 706 479        | 0,26              |
| 281 200 QL Resources Bhd   | 370 260           | 0,04              | 54 000 Giant Manufacturing Co Ltd                                  | 312 144          | 0,03              |
| 204 906 RHB Bank Bhd   | 259 122           | 0,02              | 40 000 Globalwafers Co Ltd   | 680 516          | 0,07              |
| 597 762 Sime Darby Bhd   | 291 261           | 0,03              | 2 463 266 Hon Hai Precision Industry Co Ltd                        | 8 413 816        | 0,82              |
| 454 437 Sime Darby Plantation Bhd                                  | 439 761           | 0,04              | 58 000 Hotai Motor Co Ltd  | 1 222 958        | 0,12              |
| 157 511 Telekom Malaysia Bhd                                       | 174 913           | 0,02              | 1 791 066 Hua Nan Financial Holdings Co Ltd                        | 1 314 733        | 0,13              |
| 548 900 Tenaga Nasional Bhd  | 1 148 181         | 0,11              | 1 839 820 Innolux Corp   | 876 177          | 0,08              |
| 1 036 600 Top Glove Corp Bhd                                       | 220 828           | 0,02              | 608 000 Inventec Corp  | 638 003          | 0,06              |
|  | <b>18 821 651</b> | <b>1,83</b>       | 21 000 Largan Precision Co Ltd                                     | 1 500 123        | 0,15              |
| <b>Nouveau dollar de Taïwan – 18,82 %</b>                          |                   |                   | 456 581 Lite-On Technology Corp                                    | 1 099 183        | 0,11              |
| 95 000 Accton Technology Corp                                      | 995 320           | 0,10              | 303 813 MediaTek Inc   | 7 852 889        | 0,76              |
| 635 478 Acer Inc   | 587 526           | 0,06              | 2 248 530 Mega Financial Holding Co Ltd                            | 2 437 031        | 0,24              |
| 85 951 Advantech Co Ltd  | 1 047 305         | 0,10              |  |                  |                   |

## SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                       | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                       | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|--|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %) (suite)</b>  |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %) (suite)</b>  |                    |                   |
| <b>Nouveau dollar de Taïwan – 18,82 % (suite)</b>                  |                  |                   | <b>Nouveau dollar de Taïwan – 18,82 % (suite)</b>                  |                    |                   |
| 130 000 Micro-Star International Co Ltd                            | 614 829          | 0,06              | 1 980 997 Yuanta Financial Holding Co Ltd                          | 1 454 152          | 0,14              |
| 10 800 momo.com Inc  | 320 302          | 0,03              | 171 000 Zhen Ding Technology Holding Ltd                           | 640 250            | 0,06              |
| 980 700 Nan Ya Plastics Corp                                       | 2 496 239        | 0,24              |  | <b>193 847 084</b> | <b>18,82</b>      |
| 50 000 Nan Ya Printed Circuit Board Corp                           | 464 734          | 0,05              | <b>Peso philippin – 0,89 %</b>                                     |                    |                   |
| 242 000 Nanya Technology Corp                                      | 528 549          | 0,05              | 481 490 Aboitiz Equity Ventures Inc                                | 428 660            | 0,04              |
| 25 000 Nien Made Enterprise Co Ltd                                 | 268 495          | 0,03              | 138 993 ACEN Corp  | 15 647             | 0,00              |
| 125 000 Novatek Microelectronics Corp                              | 1 771 492        | 0,17              | 46 691 Ayala Corp  | 558 248            | 0,06              |
| 13 000 Parade Technologies Ltd                                     | 448 313          | 0,04              | 1 492 600 Ayala Land Inc   | 727 562            | 0,07              |
| 414 000 Pegatron Corp  | 947 723          | 0,09              | 375 088 Bank of the Philippine Islands                             | 707 192            | 0,07              |
| 33 000 PharmaEssentia Corp   | 463 880          | 0,04              | 487 094 BDO Unibank Inc  | 1 151 321          | 0,11              |
| 604 000 Pou Chen Corp  | 618 928          | 0,06              | 189 160 International Container Terminal Services Inc              | 742 513            | 0,07              |
| 597 000 Powerchip Semiconductor Manufacturing Corp                 | 649 009          | 0,06              | 744 001 JG Summit Holdings Inc                                     | 655 526            | 0,06              |
| 96 000 President Chain Store Corp                                  | 849 725          | 0,08              | 136 890 Jollibee Foods Corp  | 564 028            | 0,06              |
| 596 000 Quanta Computer Inc  | 1 744 104        | 0,17              | 506 107 Metropolitan Bank & Trust Co                               | 544 601            | 0,05              |
| 97 000 Realtek Semiconductor Corp                                  | 1 234 502        | 0,12              | 821 500 Monde Nissin Corp  | 148 237            | 0,02              |
| 326 270 Ruentex Development Co Ltd                                 | 378 804          | 0,04              | 15 120 PLDT Inc  | 394 931            | 0,04              |
| 794 700 Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd                     | 1 225 426        | 0,12              | 39 127 SM Investments Corp   | 639 822            | 0,06              |
| 2 634 416 Shin Kong Financial Holding Co Ltd                       | 728 526          | 0,07              | 2 079 925 SM Prime Holdings Inc                                    | 1 254 880          | 0,12              |
| 64 000 Silergy Corp  | 1 007 899        | 0,10              | 233 650 Universal Robina Corp                                      | 618 883            | 0,06              |
| 2 271 483 SinoPac Financial Holdings Co Ltd                        | 1 238 414        | 0,12              |  | <b>9 152 051</b>   | <b>0,89</b>       |
| 269 600 Synnex Technology International Corp                       | 542 786          | 0,05              | <b>Won sud-coréen – 13,64 %</b>                                    |                    |                   |
| 2 499 571 Taishin Financial Holding Co Ltd                         | 1 362 768        | 0,13              | 7 208 Amorepacific Corp  | 757 426            | 0,07              |
| 686 000 Taiwan Business Bank                                       | 303 036          | 0,03              | 1 212 BGF retail Co Ltd  | 169 160            | 0,02              |
| 1 076 895 Taiwan Cement Corp                                       | 1 287 428        | 0,12              | 16 571 Celltrion Healthcare Co Ltd                                 | 766 274            | 0,07              |
| 1 879 376 Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd              | 1 611 026        | 0,16              | 21 055 Celltrion Inc   | 2 422 736          | 0,24              |
| 322 000 Taiwan High Speed Rail Corp                                | 319 911          | 0,03              | 3 993 Celltrion Pharm Inc  | 254 269            | 0,02              |
| 366 500 Taiwan Mobile Co Ltd                                       | 1 215 748        | 0,12              | 9 401 Cheil Worldwide Inc  | 134 460            | 0,01              |
| 4 896 865 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd                | 85 722 278       | 8,32              | 1 860 CJ CheilJedang Corp  | 465 768            | 0,05              |
| 234 000 Unimicron Technology Corp                                  | 1 133 591        | 0,11              | 3 774 CJ Corp  | 302 361            | 0,03              |
| 938 079 Uni-President Enterprises Corp                             | 2 215 219        | 0,22              | 11 812 Coway Co Ltd  | 476 345            | 0,05              |
| 193 000 Vanguard International Semiconductor Corp                  | 614 228          | 0,06              | 11 455 DB Insurance Co Ltd   | 659 046            | 0,06              |
| 10 000 Voltronic Power Technology Corp                             | 568 191          | 0,06              | 8 944 Doosan Bobcat Inc  | 300 229            | 0,03              |
| 473 705 Walsin Lihwa Corp  | 758 457          | 0,07              | 77 290 Doosan Enerbility Co Ltd                                    | 1 009 279          | 0,10              |
| 140 230 Wan Hai Lines Ltd  | 315 486          | 0,03              | 9 501 Ecopro BM Co Ltd   | 1 638 418          | 0,16              |
| 65 000 Win Semiconductors Corp                                     | 389 605          | 0,04              | 4 359 E-MART Inc   | 353 582            | 0,03              |
| 612 000 Winbond Electronics Corp                                   | 532 655          | 0,05              | 2 685 F&F Co Ltd   | 287 712            | 0,03              |
| 13 017 Winyann Corp  | 480 963          | 0,05              | 12 207 GS Holdings Corp  | 378 817            | 0,04              |
| 398 122 WPG Holdings Ltd   | 656 400          | 0,06              | 58 545 Hana Financial Group Inc                                    | 1 830 304          | 0,18              |
| 65 070 Yageo Corp  | 1 130 537        | 0,11              | 12 158 Hankook Tire & Technology Co Ltd                            | 324 998            | 0,03              |
| 343 000 Yang Ming Marine Transport Corp                            | 724 358          | 0,07              | 1 370 Hanmi Pharm Co Ltd   | 269 401            | 0,03              |
|  |                  |                   | 32 504 Hanon Systems   | 219 215            | 0,02              |
|  |                  |                   | 27 495 Hanwha Galleria Co Ltd                                      | 44 985             | 0,00              |
|  |                  |                   | 24 379 Hanwha Solutions Corp                                       | 1 005 609          | 0,10              |

## SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                       | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Won sud-coréen – 13,64 % (suite)</b>                            |                  |                   |
| 10 100 HD Hyundai Co Ltd   | 450 751          | 0,04              |
| 19 734 HLB Inc   | 526 755          | 0,05              |
| 56 082 HMM Co Ltd  | 876 651          | 0,08              |
| 7 509 Hotel Shilla Co Ltd  | 470 088          | 0,05              |
| 4 195 HYBE Co Ltd  | 608 700          | 0,06              |
| 16 920 Hyundai Engineering & Construction Co Ltd                   | 473 737          | 0,05              |
| 4 075 Hyundai Glovis Co Ltd  | 496 131          | 0,05              |
| 2 772 Hyundai Heavy Industries Co Ltd                              | 212 928          | 0,02              |
| 2 812 Hyundai Mipo Dockyard Co Ltd                                 | 151 632          | 0,01              |
| 12 186 Hyundai Mobis Co Ltd  | 2 021 873        | 0,20              |
| 28 170 Hyundai Motor Co  | 3 992 292        | 0,39              |
| 17 746 Hyundai Steel Co  | 473 009          | 0,05              |
| 3 511 Ijin Materials Co Ltd  | 185 549          | 0,02              |
| 60 711 Industrial Bank of Korea                                    | 471 007          | 0,05              |
| 63 941 Kakao   | 3 000 956        | 0,29              |
| 4 924 Kakao Games Corp   | 157 722          | 0,02              |
| 22 858 KakaoBank Corp  | 424 028          | 0,04              |
| 5 638 Kakaopay Corp  | 240 790          | 0,02              |
| 21 451 Kangwon Land Inc  | 327 899          | 0,03              |
| 54 267 Kia Corp  | 3 376 447        | 0,33              |
| 14 435 Korea Aerospace Industries Ltd                              | 525 574          | 0,05              |
| 8 276 Korea Investment Holdings Co Ltd                             | 349 641          | 0,03              |
| 8 312 Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd             | 494 819          | 0,05              |
| 2 041 Korea Zinc Co Ltd  | 866 976          | 0,08              |
| 28 200 Korean Air Lines Co Ltd                                     | 502 546          | 0,05              |
| 5 277 Krafon Inc   | 743 810          | 0,07              |
| 21 115 KT&G Corp   | 1 360 793        | 0,13              |
| 4 032 Kumho Petrochemical Co Ltd                                   | 445 058          | 0,04              |
| 4 392 L&F Co Ltd   | 1 057 643        | 0,10              |
| 9 967 LG Chem Ltd  | 5 451 092        | 0,53              |
| 17 464 LG Corp   | 1 110 742        | 0,11              |
| 23 024 LG Electronics Inc  | 2 039 150        | 0,20              |
| 6 332 LG Energy Solution Ltd                                       | 2 840 487        | 0,28              |
| 1 897 LG H&H Co Ltd  | 874 294          | 0,08              |
| 2 898 LG Innotek Co Ltd  | 602 150          | 0,06              |
| 40 204 LG Uplus Corp   | 334 454          | 0,03              |
| 4 566 Lotte Chemical Corp  | 669 196          | 0,06              |
| 2 052 Lotte Shopping Co Ltd  | 129 092          | 0,01              |
| 12 191 Meritz Financial Group Inc                                  | 361 465          | 0,03              |
| 62 839 Meritz Securities Co Ltd                                    | 294 441          | 0,03              |
| 76 131 Mirae Asset Securities Co Ltd                               | 377 775          | 0,04              |
| 25 567 NAVER Corp  | 3 967 073        | 0,39              |

| Participation Investissement                                       | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|--|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %) (suite)</b>  |                    |                   |
| <b>Won sud-coréen – 13,64 % (suite)</b>                            |                    |                   |
| 3 292 NCSOFT Corp  | 939 415            | 0,09              |
| 5 447 Netmarble Corp   | 277 402            | 0,03              |
| 14 327 NH Investment & Securities Co Ltd                           | 96 845             | 0,01              |
| 6 080 Orion Corp/Republic of Korea                                 | 637 960            | 0,06              |
| 46 833 Pan Ocean Co Ltd  | 209 010            | 0,02              |
| 5 871 Pearl Abyss Corp   | 208 575            | 0,02              |
| 5 361 POSCO Chemical Co Ltd  | 1 122 151          | 0,11              |
| 5 965 S-1 Corp   | 253 381            | 0,02              |
| 3 555 Samsung Biologics Co Ltd                                     | 2 151 815          | 0,21              |
| 18 455 Samsung C&T Corp  | 1 533 841          | 0,15              |
| 12 153 Samsung Electro-Mechanics Co Ltd                            | 1 425 481          | 0,14              |
| 952 262 Samsung Electronics Co Ltd (Voting rights)                 | 46 813 971         | 4,55              |
| 37 887 Samsung Engineering Co Ltd                                  | 922 547            | 0,09              |
| 7 347 Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd                       | 1 162 563          | 0,11              |
| 164 107 Samsung Heavy Industries Co Ltd                            | 651 713            | 0,06              |
| 13 569 Samsung Life Insurance Co Ltd                               | 654 556            | 0,06              |
| 11 187 Samsung SDI Co Ltd  | 6 315 970          | 0,61              |
| 6 800 Samsung SDS Co Ltd   | 605 907            | 0,06              |
| 10 248 Samsung Securities Co Ltd                                   | 249 538            | 0,02              |
| 4 344 SD Biosensor Inc   | 70 406             | 0,01              |
| 93 469 Shinhan Financial Group Co Ltd                              | 2 538 026          | 0,25              |
| 4 007 SK Biopharmaceuticals Co Ltd                                 | 194 833            | 0,02              |
| 3 855 SK Bioscience Co Ltd   | 213 500            | 0,02              |
| 108 697 SK Hynix Inc   | 7 397 591          | 0,72              |
| 4 954 SK IE Technology Co Ltd                                      | 270 941            | 0,03              |
| 6 945 SK Inc   | 920 239            | 0,09              |
| 10 464 SK Innovation Co Ltd  | 1 441 176          | 0,14              |
| 18 130 SK Square Co Ltd  | 553 572            | 0,05              |
| 3 062 SKC Co Ltd   | 268 838            | 0,03              |
| 9 264 S-Oil Corp   | 569 994            | 0,06              |
| 97 774 Woori Financial Group Inc                                   | 856 935            | 0,08              |
| 13 373 Yuhan   | 519 779            | 0,05              |
|  | <b>140 456 081</b> | <b>13,64</b>      |
| <b>Baht thaïlandais – 2,14 %</b>                                   |                    |                   |
| 248 144 Advanced Info Service PCL                                  | 1 538 427          | 0,15              |
| 850 145 Airports of Thailand PCL                                   | 1 765 179          | 0,17              |
| 1 912 868 Bangkok Dusit Medical Services PCL                       | 1 650 230          | 0,16              |
| 1 665 300 Bangkok Expressway & Metro PCL                           | 430 996            | 0,04              |
| 174 900 Berli Jucker PCL   | 195 640            | 0,02              |
| 1 464 700 BTS Group Holdings PCL                                   | 304 120            | 0,03              |
| 79 663 Bumrungrad Hospital PCL (Voting rights)                     | 526 505            | 0,05              |

## SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b>  |                   |                   |
| <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %) (suite)</b>   |                   |                   |
| <b>Baht thaïlandais – 2,14 % (suite)</b>                            |                   |                   |
| 460 205 Central Pattana PCL   | 925 255           | 0,09              |
| 332 113 Central Retail Corp PCL                                     | 434 627           | 0,04              |
| 568 233 Charoen Pokphand Foods PCL                                  | 352 290           | 0,03              |
| 1 230 616 CP ALL PCL  | 2 231 267         | 0,22              |
| 60 955 Delta Electronics Thailand PCL                               | 2 035 696         | 0,20              |
| 324 607 Energy Absolute PCL   | 721 454           | 0,07              |
| 1 434 605 Home Product Center PCL                                   | 604 133           | 0,06              |
| 333 878 Indorama Ventures PCL                                       | 336 856           | 0,03              |
| 855 066 Krung Thai Bank PCL   | 412 592           | 0,04              |
| 771 104 Minor International PCL                                     | 727 244           | 0,07              |
| 308 159 PTT Exploration & Production PCL                            | 1 356 278         | 0,13              |
| 456 031 PTT Global Chemical PCL                                     | 610 131           | 0,06              |
| 605 000 PTT Oil & Retail Business PCL                               | 376 853           | 0,04              |
| 1 889 597 PTT PCL   | 1 740 673         | 0,17              |
| 175 328 SCB X PCL   | 525 548           | 0,05              |
| 140 198 Siam Cement PCL   | 1 291 486         | 0,12              |
| 311 167 Thai Oil PCL  | 477 738           | 0,05              |
| 2 106 574 True Corp PCL   | 517 480           | 0,05              |
|   | <b>22 088 698</b> | <b>2,14</b>       |
| <b>Dollar américain – 0,61 %</b>                                    |                   |                   |
| 278 300 Inner Mongolia Yitai Coal Co Ltd                            | 408 823           | 0,04              |
| 102 010 Shanghai Baosight Software Co Ltd                           | 336 837           | 0,03              |
| 361 840 Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co Ltd   | 279 702           | 0,03              |
| 83 557 Yum China Holdings Inc                                       | 5 296 678         | 0,51              |
|   | <b>6 322 040</b>  | <b>0,61</b>       |
| <b>Yuan Renminbi – 6,51 %</b>                                       |                   |                   |
| 30 400 37 Interactive Entertainment Network Technology Group Co Ltd | 125 942           | 0,01              |
| 8 060 Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc China                | 173 129           | 0,02              |
| 23 200 AECC Aero-Engine Control Co Ltd                              | 82 296            | 0,01              |
| 17 300 AECC Aviation Power Co Ltd                                   | 108 703           | 0,01              |
| 874 500 Agricultural Bank of China Ltd                              | 396 036           | 0,04              |
| 77 249 Aier Eye Hospital Group Co Ltd                               | 349 501           | 0,03              |
| 206 270 Air China Ltd   | 321 391           | 0,03              |
| 244 800 Aluminum Corp of China Ltd                                  | 196 773           | 0,02              |
| 60 100 Anhui Conch Cement Co Ltd                                    | 247 233           | 0,02              |
| 6 300 Anhui Gujing Distillery Co Ltd                                | 271 548           | 0,03              |
| 6 020 Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd                          | 116 880           | 0,01              |
| 453 903 AVIC Industry-Finance Holdings Co Ltd                       | 270 995           | 0,03              |
| 30 200 AVICOPTER PLC  | 186 065           | 0,02              |
| 239 500 Bank of Beijing Co Ltd                                      | 153 452           | 0,02              |
| 117 700 Bank of Chengdu Co Ltd                                      | 232 408           | 0,02              |

| Participation Investissement                                       | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Yuan Renminbi – 6,51 % (suite)</b>                              |                  |                   |
| 201 300 Bank of China Ltd  | 99 077           | 0,01              |
| 431 100 Bank of Communications Co Ltd                              | 320 784          | 0,03              |
| 141 400 Bank of Hangzhou Co Ltd                                    | 239 054          | 0,02              |
| 181 220 Bank of Jiangsu Co Ltd                                     | 185 250          | 0,02              |
| 119 700 Bank of Nanjing Co Ltd                                     | 156 177          | 0,02              |
| 81 540 Bank of Ningbo Co Ltd                                       | 324 270          | 0,03              |
| 78 650 Bank of Shanghai Co Ltd                                     | 68 602           | 0,01              |
| 325 700 Baoshan Iron & Steel Co Ltd                                | 295 949          | 0,03              |
| 235 800 BBMG Corp  | 84 125           | 0,01              |
| 5 075 Beijing Kingsoft Office Software Inc                         | 349 552          | 0,03              |
| 7 830 Beijing Wantai Biological Pharmacy Enterprise Co Ltd         | 132 433          | 0,01              |
| 11 600 BGI Genomics Co Ltd   | 116 552          | 0,01              |
| 571 900 BOE Technology Group Co Ltd                                | 369 758          | 0,04              |
| 21 661 BYD Co Ltd (Class A)  | 807 544          | 0,08              |
| 5 800 Changchun High & New Technology Industry Group Inc           | 137 920          | 0,01              |
| 284 800 Changjiang Securities Co Ltd                               | 230 999          | 0,02              |
| 6 900 Changzhou Xingyu Automotive Lighting Systems Co Ltd          | 120 471          | 0,01              |
| 178 300 China Construction Bank Corp                               | 154 224          | 0,02              |
| 64 000 China CSSC Holdings Ltd                                     | 218 077          | 0,02              |
| 293 700 China Eastern Airlines Corp Ltd                            | 220 255          | 0,02              |
| 954 400 China Energy Engineering Corp Ltd                          | 334 936          | 0,03              |
| 511 000 China Everbright Bank Co Ltd                               | 223 976          | 0,02              |
| 47 300 China Jushi Co Ltd  | 100 630          | 0,01              |
| 42 000 China Life Insurance Co Ltd                                 | 203 600          | 0,02              |
| 267 630 China Merchants Bank Co Ltd                                | 1 335 558        | 0,13              |
| 68 900 China Merchants Securities Co Ltd                           | 138 356          | 0,01              |
| 43 700 China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co Ltd      | 86 671           | 0,01              |
| 398 660 China Minsheng Banking Corp Ltd                            | 200 279          | 0,02              |
| 167 200 China National Nuclear Power Co Ltd                        | 155 579          | 0,02              |
| 55 900 China Northern Rare Earth Group High-Tech Co Ltd            | 212 373          | 0,02              |
| 119 300 China Pacific Insurance Group Co Ltd                       | 450 287          | 0,04              |
| 394 300 China Petroleum & Chemical Corp                            | 322 684          | 0,03              |
| 323 900 China Railway Group Ltd (Class A)                          | 324 499          | 0,03              |
| 71 800 China Shenhua Energy Co Ltd                                 | 294 527          | 0,03              |
| 211 300 China Southern Airlines Co Ltd                             | 242 152          | 0,02              |
| 522 240 China State Construction Engineering Corp Ltd              | 441 075          | 0,04              |
| 456 200 China Three Gorges Renewables Group Co Ltd                 | 364 041          | 0,04              |
| 24 300 China Tourism Group Duty Free Corp Ltd                      | 648 396          | 0,06              |

## SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                       | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Yuan Renminbi – 6,51 % (suite)</b>                              |                  |                   |
| 367 200 China United Network Communications Ltd                    | 289 812          | 0,03              |
| 143 000 China Vanke Co Ltd   | 317 347          | 0,03              |
| 256 000 China Yangtze Power Co Ltd                                 | 792 160          | 0,08              |
| 11 100 Chongqing Brewery Co Ltd                                    | 202 044          | 0,02              |
| 195 248 Chongqing Changan Automobile Co Ltd                        | 338 904          | 0,03              |
| 20 800 Chongqing Zhifei Biological Products Co Ltd                 | 248 153          | 0,02              |
| 184 390 CITIC Securities Co Ltd                                    | 549 897          | 0,05              |
| 259 900 CMOG Group Ltd   | 226 698          | 0,02              |
| 29 900 Contemporary Amperex Technology Co Ltd                      | 1 767 928        | 0,17              |
| 153 230 COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd                             | 246 112          | 0,02              |
| 291 700 CRRC Corp Ltd  | 259 957          | 0,03              |
| 37 500 CSC Financial Co Ltd  | 139 957          | 0,01              |
| 178 044 Daqin Railway Co Ltd                                       | 186 410          | 0,02              |
| 88 600 Dongfang Electric Corp Ltd                                  | 244 617          | 0,02              |
| 175 300 Dongxing Securities Co Ltd                                 | 214 425          | 0,02              |
| 203 760 East Money Information Co Ltd                              | 594 311          | 0,06              |
| 7 400 Ecovacs Robotics Co Ltd                                      | 89 007           | 0,01              |
| 30 013 Eve Energy Co Ltd   | 304 618          | 0,03              |
| 55 100 Everbright Securities Co Ltd                                | 122 279          | 0,01              |
| 172 300 FAW Jiefang Group Co Ltd                                   | 208 246          | 0,02              |
| 15 900 Flat Glass Group Co Ltd                                     | 79 439           | 0,01              |
| 293 600 Focus Media Information Technology Co Ltd                  | 293 715          | 0,03              |
| 55 752 Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd                     | 621 388          | 0,06              |
| 220 800 Foxconn Industrial Internet Co Ltd                         | 553 664          | 0,05              |
| 41 000 Fuyao Glass Industry Group Co Ltd                           | 207 528          | 0,02              |
| 28 540 Ganfeng Lithium Group Co Ltd                                | 276 244          | 0,03              |
| 194 300 GEM Co Ltd   | 211 353          | 0,02              |
| 58 600 Gemdale Corp  | 71 679           | 0,01              |
| 66 300 GF Securities Co Ltd  | 152 251          | 0,02              |
| 8 428 GigaDevice Semiconductor Inc                                 | 149 726          | 0,01              |
| 7 800 Ginlong Technologies Co Ltd                                  | 151 723          | 0,02              |
| 56 100 GoerTek Inc   | 174 820          | 0,02              |
| 22 000 Gotion High-tech Co Ltd                                     | 95 499           | 0,01              |
| 27 800 Great Wall Motor Co Ltd                                     | 113 065          | 0,01              |
| 35 400 Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai                      | 189 441          | 0,02              |
| 26 000 Guangdong Haid Group Co Ltd                                 | 220 841          | 0,02              |
| 152 600 Guanghui Energy Co Ltd                                     | 205 547          | 0,02              |
| 63 700 Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd         | 306 845          | 0,03              |

| Participation Investissement                                       | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Yuan Renminbi – 6,51 % (suite)</b>                              |                  |                   |
| 166 500 Guangzhou Haige Communications Group Inc Co                | 254 576          | 0,02              |
| 29 886 Guangzhou Tinci Materials Technology Co Ltd                 | 182 607          | 0,02              |
| 68 000 Guosen Securities Co Ltd                                    | 92 782           | 0,01              |
| 155 200 Guotai Junan Securities Co Ltd                             | 324 534          | 0,03              |
| 254 700 Guoyuan Securities Co Ltd                                  | 250 720          | 0,02              |
| 77 200 Haier Smart Home Co Ltd                                     | 254 961          | 0,03              |
| 102 200 Haitong Securities Co Ltd                                  | 131 112          | 0,01              |
| 21 560 Hangzhou First Applied Material Co Ltd                      | 184 447          | 0,02              |
| 22 700 Hangzhou Silan Microelectronics Co Ltd                      | 122 337          | 0,01              |
| 12 000 Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd                         | 167 245          | 0,02              |
| 65 100 Heilongjiang Agriculture Co Ltd                             | 127 218          | 0,01              |
| 27 500 Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd             | 103 876          | 0,01              |
| 118 090 Hengli Petrochemical Co Ltd                                | 278 575          | 0,03              |
| 198 100 Hengyi Petrochemical Co Ltd                                | 234 236          | 0,02              |
| 231 000 Hesteel Co Ltd   | 78 376           | 0,01              |
| 4 100 Hithink RoyalFlush Information Network Co Ltd                | 121 974          | 0,01              |
| 9 200 Hoshine Silicon Industry Co Ltd                              | 111 207          | 0,01              |
| 257 300 Huadian Power International Corp Ltd                       | 216 936          | 0,02              |
| 29 000 Huadong Medicine Co Ltd                                     | 195 690          | 0,02              |
| 40 820 Hualan Biological Engineering Inc                           | 129 760          | 0,01              |
| 188 900 Huaneng Power International Inc                            | 235 736          | 0,02              |
| 160 000 Huatai Securities Co Ltd                                   | 297 526          | 0,03              |
| 114 300 Huaxi Securities Co Ltd                                    | 136 981          | 0,01              |
| 369 700 Huaxia Bank Co Ltd   | 289 631          | 0,03              |
| 93 693 Huayu Automotive Systems Co Ltd                             | 228 390          | 0,02              |
| 12 300 Huizhou Desay Sv Automotive Co Ltd                          | 198 722          | 0,02              |
| 29 101 Hundsun Technologies Inc                                    | 225 526          | 0,02              |
| 21 800 Iflytek Co Ltd  | 202 150          | 0,02              |
| 2 840 Imeik Technology Development Co Ltd                          | 231 073          | 0,02              |
| 762 500 Industrial & Commercial Bank of China Ltd                  | 495 209          | 0,05              |
| 300 200 Industrial Bank Co Ltd                                     | 738 336          | 0,07              |
| 288 740 Industrial Securities Co Ltd                               | 257 319          | 0,03              |
| 389 300 Inner Mongolia BaoTou Steel Union Co Ltd                   | 107 142          | 0,01              |
| 56 968 Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd                 | 241 566          | 0,02              |
| 26 432 Inspur Electronic Information Industry Co Ltd               | 135 099          | 0,01              |
| 28 060 JA Solar Technology Co Ltd                                  | 234 293          | 0,02              |
| 20 870 Jaftron Biomedical Co Ltd                                   | 92 235           | 0,01              |
| 57 200 Jiangsu Eastern Shenghong Co Ltd                            | 113 445          | 0,01              |

## SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                       | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Yuan Renminbi – 6,51 % (suite)</b>                              |                  |                   |
| 19 900 Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd                             | 191 892          | 0,02              |
| 93 166 Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co Ltd                      | 580 922          | 0,06              |
| 32 600 Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd                         | 307 852          | 0,03              |
| 25 700 Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd                   | 619 213          | 0,06              |
| 46 000 Jiangsu Yuyue Medical Equipment & Supply Co Ltd             | 213 277          | 0,02              |
| 80 700 Jiangsu Zhongtian Technology Co Ltd                         | 200 830          | 0,02              |
| 15 200 Kweichow Moutai Co Ltd                                      | 4 028 366        | 0,39              |
| 52 200 Lens Technology Co Ltd                                      | 102 693          | 0,01              |
| 13 700 Lepu Medical Technology Beijing Co Ltd                      | 46 243           | 0,00              |
| 837 700 Liaoning Port Co Ltd (Class A)                             | 195 174          | 0,02              |
| 116 700 Lingyi iTech Guangdong Co                                  | 105 020          | 0,01              |
| 101 129 LONGi Green Energy Technology Co Ltd                       | 595 084          | 0,06              |
| 89 468 Luxshare Precision Industry Co Ltd                          | 394 882          | 0,04              |
| 19 025 Luzhou Laojiao Co Ltd                                       | 705 864          | 0,07              |
| 24 000 Mango Excellent Media Co Ltd                                | 130 147          | 0,01              |
| 10 944 Maxscend Microelectronics Co Ltd                            | 198 249          | 0,02              |
| 286 600 Metallurgical Corp of China Ltd (Class A)                  | 162 763          | 0,02              |
| 14 067 Montage Technology Co Ltd                                   | 142 405          | 0,01              |
| 77 330 Muyuan Foods Co Ltd   | 551 770          | 0,05              |
| 65 023 Nanjing King-Friend Biochemical Pharmaceutical Co Ltd       | 154 336          | 0,02              |
| 104 360 NARI Technology Co Ltd                                     | 411 981          | 0,04              |
| 7 600 NAURA Technology Group Co Ltd                                | 294 215          | 0,03              |
| 20 000 New China Life Insurance Co Ltd                             | 88 827           | 0,01              |
| 38 200 New Hope Liuhe Co Ltd                                       | 73 593           | 0,01              |
| 41 200 Ninestar Corp   | 268 895          | 0,03              |
| 4 000 Ningbo Deye Technology Co Ltd                                | 150 254          | 0,01              |
| 25 000 Ningbo Tuopu Group Co Ltd                                   | 233 425          | 0,02              |
| 125 600 Ningxia Baofeng Energy Group Co Ltd                        | 269 771          | 0,03              |
| 83 968 Orient Securities Co Ltd/China                              | 119 705          | 0,01              |
| 25 969 Ovctek China Inc  | 125 245          | 0,01              |
| 33 750 Perfect World Co Ltd/China                                  | 83 646           | 0,01              |
| 170 000 PetroChina Co Ltd  | 146 550          | 0,01              |
| 19 500 Pharmaron Beijing Co Ltd                                    | 139 052          | 0,01              |
| 270 900 Ping An Bank Co Ltd  | 494 281          | 0,05              |
| 147 900 Ping An Insurance Group Co of China Ltd                    | 982 080          | 0,10              |
| 158 400 Poly Developments and Holdings Group Co Ltd                | 325 920          | 0,03              |
| 355 600 Postal Savings Bank of China Co Ltd                        | 240 785          | 0,02              |
| 193 700 Power Construction Corp of China Ltd                       | 201 110          | 0,02              |

| Participation Investissement                                       | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Yuan Renminbi – 6,51 % (suite)</b>                              |                  |                   |
| 90 000 Qinghai Salt Lake Industry Co Ltd                           | 293 041          | 0,03              |
| 114 000 Rongsheng Petrochemical Co Ltd                             | 251 164          | 0,02              |
| 133 500 SAIC Motor Corp Ltd  | 279 158          | 0,03              |
| 6 100 Sangfor Technologies Inc                                     | 131 428          | 0,01              |
| 124 000 Sany Heavy Industry Co Ltd                                 | 308 587          | 0,03              |
| 39 900 Satellite Chemical Co Ltd                                   | 92 962           | 0,01              |
| 211 820 Sealand Securities Co Ltd                                  | 104 872          | 0,01              |
| 18 700 Seazen Holdings Co Ltd                                      | 44 495           | 0,00              |
| 58 500 SF Holding Co Ltd   | 471 762          | 0,05              |
| 5 569 SG Micro Corp  | 125 859          | 0,01              |
| 105 400 Shaanxi Coal Industry Co Ltd                               | 312 180          | 0,03              |
| 109 500 Shandong Gold Mining Co Ltd                                | 351 431          | 0,03              |
| 44 687 Shandong Linglong Tyre Co Ltd                               | 127 151          | 0,01              |
| 419 100 Shandong Nanshan Aluminum Co Ltd                           | 206 886          | 0,02              |
| 41 779 Shanghai Baosight Software Co Ltd                           | 354 075          | 0,03              |
| 26 026 Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd                  | 122 753          | 0,01              |
| 10 000 Shanghai International Airport Co Ltd                       | 81 153           | 0,01              |
| 65 300 Shanghai International Port Group Co Ltd                    | 52 679           | 0,01              |
| 15 858 Shanghai Junshi Biosciences Co Ltd                          | 110 934          | 0,01              |
| 21 818 Shanghai M&G Stationery Inc                                 | 155 995          | 0,02              |
| 49 000 Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd                     | 145 345          | 0,01              |
| 308 300 Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd                    | 322 787          | 0,03              |
| 21 000 Shanghai Putailai New Energy Technology Co Ltd              | 152 623          | 0,02              |
| 118 500 Shanxi Meijin Energy Co Ltd                                | 158 407          | 0,02              |
| 128 040 Shanxi Securities Co Ltd                                   | 108 327          | 0,01              |
| 15 640 Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd                   | 620 380          | 0,06              |
| 78 400 Shengyi Technology Co Ltd                                   | 210 747          | 0,02              |
| 18 040 Shennan Circuits Co Ltd                                     | 242 519          | 0,02              |
| 495 100 Shenwan Hongyuan Group Co Ltd                              | 300 637          | 0,03              |
| 72 240 Shenzhen Energy Group Co Ltd                                | 64 274           | 0,01              |
| 37 150 Shenzhen Inovance Technology Co Ltd                         | 380 302          | 0,04              |
| 23 360 Shenzhen Kangtai Biological Products Co Ltd                 | 107 628          | 0,01              |
| 15 000 Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd             | 680 857          | 0,07              |
| 134 000 Shenzhen Overseas Chinese Town Co Ltd                      | 94 247           | 0,01              |
| 8 662 Shenzhen Transsion Holdings Co Ltd                           | 127 648          | 0,01              |
| 49 520 Songcheng Performance Development Co Ltd                    | 117 323          | 0,01              |

## SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                       | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %) (suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Yuan Renminbi – 6,51 % (suite)</b>                              |                  |                   |
| 246 000 Southwest Securities Co Ltd                                | 139 347          | 0,01              |
| 2 800 StarPower Semiconductor Ltd                                  | 111 942          | 0,01              |
| 23 560 Sungrow Power Supply Co Ltd                                 | 359 749          | 0,04              |
| 25 500 Sunwoda Electronic Co Ltd                                   | 74 859           | 0,01              |
| 3 040 Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd                           | 135 017          | 0,01              |
| 12 900 Suzhou TA&A Ultra Clean Technology Co Ltd                   | 96 159           | 0,01              |
| 70 300 TBEA Co Ltd   | 222 244          | 0,02              |
| 370 000 TCL Technology Group Corp                                  | 238 682          | 0,02              |
| 60 900 TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd            | 429 749          | 0,04              |
| 24 100 Tianqi Lithium Corp   | 265 029          | 0,03              |
| 349 500 Tongling Nonferrous Metals Group Co Ltd                    | 163 877          | 0,02              |
| 46 200 Tongwei Co Ltd  | 261 768          | 0,03              |
| 6 400 Topchoice Medical Corp                                       | 120 483          | 0,01              |
| 28 412 Trina Solar Co Ltd  | 215 511          | 0,02              |
| 24 000 Tsingtao Brewery Co Ltd                                     | 421 476          | 0,04              |
| 10 839 Unigroup Guoxin Microelectronics Co Ltd                     | 175 402          | 0,02              |
| 46 060 Unisplendour Corp Ltd                                       | 196 452          | 0,02              |
| 37 500 Walvax Biotechnology Co Ltd                                 | 188 338          | 0,02              |
| 45 600 Wanhua Chemical Group Co Ltd                                | 636 659          | 0,06              |
| 138 200 Weichai Power Co Ltd                                       | 253 768          | 0,02              |
| 44 760 Wens Foodstuffs Group Co Ltd                                | 133 420          | 0,01              |
| 229 900 Western Securities Co Ltd                                  | 213 252          | 0,02              |
| 19 910 Will Semiconductor Co Ltd Shanghai                          | 264 121          | 0,03              |
| 22 300 Wingtech Technology Co Ltd                                  | 179 412          | 0,02              |
| 50 100 Wuliangye Yibin Co Ltd                                      | 1 437 202        | 0,14              |
| 27 092 WuXi AppTec Co Ltd  | 313 633          | 0,03              |
| 7 420 Wuxi Shangji Automation Co Ltd                               | 110 328          | 0,01              |
| 106 925 Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd              | 171 895          | 0,02              |
| 39 903 Yankuang Energy Group Co Ltd                                | 206 682          | 0,02              |
| 20 250 Yealink Network Technology Corp Ltd                         | 224 135          | 0,02              |
| 20 500 Yihai Kerry Arawana Holdings Co Ltd                         | 128 660          | 0,01              |
| 9 400 YongXing Special Materials Technology Co Ltd                 | 114 843          | 0,01              |
| 51 160 Yonyou Network Technology Co Ltd                            | 187 362          | 0,02              |
| 40 600 YTO Express Group Co Ltd                                    | 108 309          | 0,01              |
| 62 205 Yunda Holding Co Ltd  | 107 158          | 0,01              |
| 28 820 Yunnan Baiyao Group Co Ltd                                  | 229 560          | 0,02              |
| 12 600 Yunnan Energy New Material Co Ltd                           | 208 835          | 0,02              |
| 7 400 Zhangzhou Pientzheuang Pharmaceutical Co Ltd                 | 306 440          | 0,03              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|---|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b>        |                    |                   |
| <b>Actions ordinaires – 94,00 % (mars 2022 : 93,80 %) (suite)</b>         |                    |                   |
| <b>Yuan Renminbi – 6,51 % (suite)</b>                                     |                    |                   |
| 148 800 Zhejiang Century Huatong Group Co Ltd                             | 130 441            | 0,01              |
| 33 300 Zhejiang Chint Electrics Co Ltd                                    | 135 628            | 0,01              |
| 23 000 Zhejiang Dahua Technology Co Ltd                                   | 75 726             | 0,01              |
| 27 890 Zhejiang Huayou Cobalt Co Ltd                                      | 223 370            | 0,02              |
| 20 000 Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd                  | 190 148            | 0,02              |
| 37 080 Zhejiang NHU Co Ltd  | 96 921             | 0,01              |
| 22 200 Zhejiang Yongtai Technology Co Ltd                                 | 67 628             | 0,01              |
| 21 700 Zhongji Innolight Co Ltd   | 186 118            | 0,02              |
| 265 400 Zijin Mining Group Co Ltd   | 478 835            | 0,05              |
| 299 900 Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd             | 271 195            | 0,03              |
| 85 100 ZTE Corp (Class A)   | 403 485            | 0,04              |
|   | <b>67 084 428</b>  | <b>6,51</b>       |
| <b>Total des actions ordinaires</b>                                       |                    |                   |
|   | <b>968 052 773</b> | <b>94,00</b>      |
| <b>Certificats représentatifs de titres – 5,70 % (mars 2022 : 6,30 %)</b> |                    |                   |
| <b>Baht thaïlandais – 0,49 %</b>  |                    |                   |
| 89 600 B Grimm Power PCL  | 106 121            | 0,01              |
| 1 300 000 Banpu PCL   | 410 586            | 0,04              |
| 38 643 Electricity Generating PCL   | 175 727            | 0,02              |
| 108 500 Global Power Synergy PCL  | 215 763            | 0,02              |
| 678 650 Gulf Energy Development PCL                                       | 1 046 901          | 0,10              |
| 229 200 Intouch Holdings PCL  | 496 002            | 0,05              |
| 120 800 Kasikombank PCL   | 468 080            | 0,05              |
| 2 336 586 Land & Houses PCL   | 673 063            | 0,06              |
| 238 400 Muangthai Capital PCL   | 240 526            | 0,02              |
| 309 503 Ratch Group PCL   | 348 468            | 0,03              |
| 269 400 SCG Packaging PCL   | 364 373            | 0,04              |
| 128 700 Srisawad Corp PCL   | 198 536            | 0,02              |
| 638 729 Thai Union Group PCL  | 263 374            | 0,03              |
|   | <b>5 007 520</b>   | <b>0,49</b>       |
| <b>Dollar américain – 5,21 %</b>  |                    |                   |
| 19 148 360 DigiTech Inc   | 371 471            | 0,04              |
| 104 585 AUO Corp  | 650 519            | 0,06              |
| 14 313 Autohome Inc   | 479 056            | 0,05              |
| 45 200 China Petroleum & Chemical Corp                                    | 2 671 711          | 0,26              |
| 11 678 Daqo New Energy Corp   | 546 998            | 0,05              |
| 36 252 H World Group Ltd  | 1 775 623          | 0,17              |
| 15 666 Huaneng Power International Inc                                    | 328 888            | 0,03              |
| 69 979 iQIYI Inc  | 509 447            | 0,05              |
| 13 217 JOYY Inc   | 412 106            | 0,04              |
| 41 207 Kanzhun Ltd  | 784 169            | 0,08              |
| 76 733 KB Financial Group Inc   | 2 794 616          | 0,27              |



## SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement  | Juste valeur USD     | % des actifs nets |
|---|----------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,79 % (mars 2022 : 100,21 %) (suite)</b>                |                      |                   |
| <b>Certificats représentatifs de titres – 5,70 % (mars 2022 : 6,30 %) (suite)</b> |                      |                   |
| <b>Dollar américain – 5,21 % (suite)</b>  |                      |                   |
| 128 644 KE Holdings Inc   | 2 423 653            | 0,23              |
| 87 108 Korea Electric Power Corp  | 604 530              | 0,06              |
| 12 698 Legend Biotech Corp  | 612 298              | 0,06              |
| 66 992 LG Display Co Ltd  | 427 409              | 0,04              |
| 156 630 Lufax Holding Ltd   | 319 525              | 0,03              |
| 20 200 MINISO Group Holding Ltd   | 358 348              | 0,03              |
| 261 686 NIO Inc   | 2 750 320            | 0,27              |
| 100 023 PDD Holdings Inc  | 7 591 746            | 0,74              |
| 58 763 POSCO Holdings Inc   | 4 095 193            | 0,40              |
| 6 346 Samsung Electronics Co Ltd  | 6 587 148            | 0,64              |
| 86 783 TAL Education Group  | 556 279              | 0,05              |
| 95 038 Telkom Indonesia Persero Tbk PT  | 2 591 686            | 0,25              |
| 135 760 Tencent Music Entertainment Group   | 1 124 093            | 0,11              |
| 105 703 Trip.com Group Ltd  | 3 981 832            | 0,39              |
| 446 164 United Microelectronics Corp  | 3 908 397            | 0,38              |
| 83 832 Vipshop Holdings Ltd   | 1 272 570            | 0,12              |
| 14 475 Weibo Corp   | 290 368              | 0,03              |
| 15 407 Zai Lab Ltd  | 512 437              | 0,05              |
| 83 134 ZTO Express Cayman Inc   | 2 382 620            | 0,23              |
|   | <b>53 715 056</b>    | <b>5,21</b>       |
| <b>Total des certificats représentatifs de titres</b>                             | <b>58 722 576</b>    | <b>5,70</b>       |
| <b>Actions préférentielles – 0,09 % (mars 2022 : 0,11 %)</b>                      |                      |                   |
| <b>Won sud-coréen – 0,09 %</b>  |                      |                   |
| 5 695 Hyundai Motor Co  | 419 081              | 0,04              |
| 2 406 Hyundai Motor Co (non-cumulative preference)                                | 174 464              | 0,02              |
| 952 LG Chem Ltd   | 227 059              | 0,02              |
| 1 700 Samsung Electronics Co Ltd (Non voting rights)                              | 70 385               | 0,01              |
|   | <b>890 989</b>       | <b>0,09</b>       |
| <b>Total des actions préférentielles</b>  | <b>890 989</b>       | <b>0,09</b>       |
| <b>Droits – Néant (mars 2022 : 0,00 %)</b>  |                      |                   |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>   | <b>1 027 666 338</b> | <b>99,79</b>      |

Instruments financiers dérivés – 0,00 % (mars 2022 : 0,01 %)

Contrats à terme standardisés – 0,00 % (mars 2022 : 0,01 %)

| Montant notionnel | Prix du coût moyen   | Plus-values/ (Moins-values) latentes USD | % des actifs nets |
|-------------------|--|--|-------------------|
| 1 229 020         | 0 20 of Kospi2 Long Future Contracts Expiring                        |  |                   |
|                   | Expiring 08 June 2023  | 14 210                                   | 0,00              |
| 1 914 650         | 618 31 of MSCI Taiwan Index Long Contracts Expiring                  |  |                   |
|                   | 27 April 2023  | (5 670)                                  | (0,00)            |
| 933 527           | 28 167 of Thai SET50 Index Futures Expiring 29 June 2023             | 12 261                                   | 0,00              |
|                   | <b>Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés</b>        | <b>26 471</b>                            | <b>0,00</b>       |
|                   | <b>Moins-values latentes sur contrats à terme standardisés</b>       | <b>(5 670)</b>                           | <b>(0,00)</b>     |
|                   | <b>Plus-values latentes nettes sur contrats à terme standardisés</b> | <b>20 801</b>                            | <b>0,00</b>       |
|                   | <b>Total des instruments financiers dérivés</b>                      | <b>20 801</b>                            | <b>0,00</b>       |

|   | Juste valeur USD     | % du Comp.    |
|---|----------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | 1 027 687 139        | 99,79         |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,10 %)</b>                               | 14 450 922           | 1,40          |
| <b>Liquidités détenues auprès d'un courtier* (mars 2022 : 0,04 %)</b>               | 909 442              | 0,09          |
| <b>Montants à recevoir du courtier* (mars 2022 : (0,00 %))</b>                      | (29 102)             | (0,00)        |
| <b>Autres passifs nets (mars 2022 : (0,36 %))</b>                                   | (13 198 231)         | (1,28)        |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>1 029 820 170</b> | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company, à l'exception des liquidités détenues auprès d'un courtier et dues au courtier, en l'occurrence Barclays Capital.

Le courtier pour les contrats à terme standardisés ouverts est Barclays Capital.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

|   | % du total des actifs |
|---|-----------------------|
| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                        |                       |
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs | 98,27                 |
| Instruments financiers dérivés négociés en Bourse                       | 0,00                  |
| Autres actifs   | 1,73                  |
| <b>Total des actifs</b>   | <b>100,00</b>         |

## SPDR MSCI EMU UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>EUR        | 2022<br>EUR        |
|--|-------|--------------------|--------------------|
| <b>Actifs circulants</b>   |       |                    |                    |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                         |       |                    |                    |
|  | 1(e)  |                    |                    |
| Valeurs mobilières   |       | 219 810 056        | 229 161 732        |
| Instruments financiers dérivés   |       | 4 560              | 12 914             |
|  |       | <b>219 814 616</b> | <b>229 174 646</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie  | 1(f)  | 186 125            | 359 158            |
| Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties à des instruments financiers ouverts | 1(g)  | 11 707             | 31 871             |
| Créances :   |       |                    |                    |
| Dividendes à recevoir  |       | 921 192            | 749 608            |
| <b>Total des actifs circulants</b>   |       | <b>220 933 640</b> | <b>230 315 283</b> |
| <b>Passifs circulants</b>  |       |                    |                    |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :   |       |                    |                    |
| Charges à payer  |       | (35 889)           | (34 097)           |
| <b>Total des passifs circulants</b>  |       | <b>(35 889)</b>    | <b>(34 097)</b>    |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>              |       |                    |                    |
|  |       | <b>220 897 751</b> | <b>230 281 186</b> |
|  |       | <b>2023</b>        | <b>2022</b>        |
|  |       | <b>2021</b>        |                    |
| Valeur liquidative par action  | 5     | 64,59 EUR          | 59,50 EUR          |
|  |       |                    | 58,23 EUR          |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR MSCI EMU UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>EUR       | 2022<br>EUR      |
|---|-------|-------------------|------------------|
| Produits de dividendes  |       | 7 304 652         | 6 059 572        |
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 92                | -                |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat    | 9     | 12 549 827        | 3 695 328        |
| Produits divers   |       | 53                | -                |
| <b>Total des produits d'investissement</b>  |       | <b>19 854 624</b> | <b>9 754 900</b> |
| Charges opérationnelles   | 3     | (404 475)         | (464 158)        |
| <b>Bénéfice net pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>   |       | <b>19 450 149</b> | <b>9 290 742</b> |
| <b>Charges financières</b>  |       |                   |                  |
| Charges d'intérêts  |       | (3 555)           | (6 082)          |
| <b>Bénéfice pour l'exercice financier avant impôt</b>   |       | <b>19 446 594</b> | <b>9 284 660</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement   | 2     | (457 830)         | (376 716)        |
| <b>Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>18 988 764</b> | <b>8 907 944</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR MSCI EMU UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>EUR        | 2022<br>EUR         |
|---|--------------------|---------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier                 | 230 281 186        | 294 646 299         |
| <b>Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>18 988 764</b>  | <b>8 907 944</b>    |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                    |                     |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 9 157 789          | 48 462 882          |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (37 529 988)       | (121 735 939)       |
| Diminution des actifs nets résultant d'opérations sur actions   | (28 372 199)       | (73 273 057)        |
| <b>Diminution totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                     | <b>(9 383 435)</b> | <b>(64 365 113)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>          | <b>220 897 751</b> | <b>230 281 186</b>  |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR MSCI EMU UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

| Notes   | 2023<br>EUR         | 2022<br>EUR         |
|---|---------------------|---------------------|
| <b>Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b>                   | <b>18 988 764</b>   | <b>8 907 944</b>    |
| <b>Ajustement pour :</b>  |                     |                     |
| Variation de la trésorerie détenue par/à payer au courtier  | 20 164              | (31 871)            |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 9 351 676           | 64 161 702          |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés   | -                   | -                   |
|   | 8 354               | (12 914)            |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   | <b>28 368 958</b>   | <b>73 024 861</b>   |
| Variation des montants à recevoir   | (171 584)           | 429 740             |
| Variation des montants à payer  | 1 792               | (12 334)            |
| <b>Sorties de trésorerie sur opérations</b>   | <b>(169 792)</b>    | <b>417 406</b>      |
| <b>Sorties de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  | <b>28 199 166</b>   | <b>73 442 267</b>   |
| <b>Activités de financement</b>   |                     |                     |
| Produits des souscriptions  | 5 9 157 789         | 48 462 882          |
| Paiements sur rachats   | 5 (37 529 988)      | (121 735 939)       |
| <b>Trésorerie nette utilisée sur activités de financement (Diminution)/Augmentation nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b> | <b>(28 372 199)</b> | <b>(73 273 057)</b> |
| <b>(Diminution)/Augmentation nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>  | <b>(173 033)</b>    | <b>169 210</b>      |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  | 359 158             | 189 948             |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   | <b>186 125</b>      | <b>359 158</b>      |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |                     |                     |
| Impôts payés  | (457 830)           | (376 716)           |
| Intérêts reçus  | 92                  | -                   |
| Intérêts payés  | (3 555)             | (6 082)             |
| Dividendes reçus  | 7 133 068           | 6 489 312           |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR MSCI EMU UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                              | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,51 % (mars 2022 : 99,51 %)</b> |                     |                         |
| <b>Actions ordinaires – 97,41 % (mars 2022 : 97,41 %)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 97,03 %</b>                                     |                     |                         |
| 1 146 Acciona SA  | 211 666             | 0,10                    |
| 7 809 Accor SA  | 234 036             | 0,11                    |
| 9 441 ACS Actividades de Construcción y Servicios SA      | 277 093             | 0,13                    |
| 7 877 adidas AG   | 1 282 218           | 0,58                    |
| 980 Adyen NV  | 1 430 016           | 0,65                    |
| 80 708 Aegon NV   | 318 877             | 0,14                    |
| 3 343 Aena SME SA   | 497 773             | 0,23                    |
| 1 312 Aeroports de Paris                                  | 172 725             | 0,08                    |
| 7 539 Ageas SA/NV   | 300 505             | 0,14                    |
| 48 032 AIB Group PLC                                      | 179 736             | 0,08                    |
| 23 910 Air Liquide SA                                     | 3 686 922           | 1,67                    |
| 27 029 Airbus   | 3 332 135           | 1,51                    |
| 8 312 Akzo Nobel NV                                       | 598 298             | 0,27                    |
| 18 689 Allianz SE   | 3 977 019           | 1,80                    |
| 13 959 Alstom SA  | 350 092             | 0,16                    |
| 20 606 Amadeus IT Group SA                                | 1 270 566           | 0,58                    |
| 5 402 Amplifon SpA  | 172 540             | 0,08                    |
| 2 575 Amundi SA   | 149 479             | 0,07                    |
| 39 676 Anheuser-Busch InBev SA/NV                         | 2 433 329           | 1,10                    |
| 24 306 ArcelorMittal SA                                   | 677 408             | 0,31                    |
| 2 501 Argenx SE (Belgium listing)                         | 852 091             | 0,39                    |
| 2 776 Arkema SA   | 252 061             | 0,11                    |
| 43 216 Aroundtown SA                                      | 56 743              | 0,03                    |
| 2 210 ASM International NV                                | 821 899             | 0,37                    |
| 18 584 ASML Holding NV                                    | 11 618 717          | 5,26                    |
| 52 039 Assicurazioni Generali SpA                         | 956 477             | 0,43                    |
| 86 025 AXA SA   | 2 422 894           | 1,10                    |
| 277 076 Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA                | 1 820 666           | 0,82                    |
| 764 849 Banco Santander SA                                | 2 620 373           | 1,19                    |
| 48 406 Bank of Ireland Group PLC                          | 451 338             | 0,20                    |
| 42 158 BASF SE  | 2 038 761           | 0,92                    |
| 45 052 Bayer AG   | 2 645 453           | 1,20                    |
| 15 330 Bayerische Motoren Werke AG (Voting rights)        | 1 547 410           | 0,70                    |
| 3 514 Bechtle AG  | 154 581             | 0,07                    |
| 4 764 Beiersdorf AG                                       | 571 442             | 0,26                    |
| 2 099 BioMerieux  | 203 603             | 0,09                    |
| 50 512 BNP Paribas SA                                     | 2 788 768           | 1,26                    |
| 46 647 Bollore SE   | 265 421             | 0,12                    |
| 11 321 Bouygues SA  | 351 970             | 0,16                    |
| 7 356 Brenntag SE   | 509 035             | 0,23                    |
| 12 967 Bureau Veritas SA                                  | 343 237             | 0,16                    |
| 201 144 CaixaBank SA                                      | 720 900             | 0,33                    |
| 7 431 Capgemini SE  | 1 268 843           | 0,57                    |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,51 % (mars 2022 : 99,51 %)</b>         |                     |                         |
| <b>(suite)</b>  |                     |                         |
| <b>Actions ordinaires – 97,41 % (mars 2022 : 97,41 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 97,03 % (suite)</b>                                     |                     |                         |
| 1 791 Carl Zeiss Meditec AG                                       | 229 248             | 0,10                    |
| 27 330 Carrefour SA   | 509 158             | 0,23                    |
| 25 849 Cellnex Telecom SA   | 924 360             | 0,42                    |
| 22 723 Cie de Saint-Gobain  | 1 188 867           | 0,54                    |
| 31 175 Cie Generale des Etablissements Michelin SCA               | 877 420             | 0,40                    |
| 47 618 CNH Industrial NV  | 670 461             | 0,30                    |
| 48 942 Commerzbank AG   | 474 835             | 0,22                    |
| 4 957 Continental AG  | 341 636             | 0,16                    |
| 2 978 Corp ACCIONA Energias Renovables SA                         | 106 493             | 0,05                    |
| 8 620 Covestro AG   | 328 681             | 0,15                    |
| 55 608 Credit Agricole SA   | 578 212             | 0,26                    |
| 34 590 CRH PLC  | 1 607 570           | 0,73                    |
| 20 451 Daimler Truck Holding AG                                   | 636 231             | 0,29                    |
| 29 364 Danone SA  | 1 682 851           | 0,76                    |
| 1 057 Dassault Aviation SA  | 193 008             | 0,09                    |
| 30 346 Dassault Systemes SE                                       | 1 149 355           | 0,52                    |
| 23 240 Davide Campari-Milano NV                                   | 261 450             | 0,12                    |
| 8 163 Delivery Hero SE  | 256 073             | 0,12                    |
| 95 660 Deutsche Bank AG   | 894 995             | 0,41                    |
| 8 642 Deutsche Boerse AG  | 1 550 807           | 0,70                    |
| 28 177 Deutsche Lufthansa AG                                      | 289 096             | 0,13                    |
| 45 334 Deutsche Post AG   | 1 953 442           | 0,88                    |
| 147 605 Deutsche Telekom AG                                       | 3 298 972           | 1,49                    |
| 1 071 DiaSorin SpA  | 103 951             | 0,05                    |
| 1 148 Dieteren Group  | 205 377             | 0,09                    |
| 102 618 E.ON SE   | 1 180 107           | 0,53                    |
| 11 750 Edenred  | 640 845             | 0,29                    |
| 134 155 EDP - Energias de Portugal                                | 672 921             | 0,30                    |
| 13 515 EDP Renovaveis SA  | 285 031             | 0,13                    |
| 3 748 Eiffage SA  | 373 826             | 0,17                    |
| 1 498 Elia Group SA/NV  | 182 157             | 0,08                    |
| 6 808 Elisa Oyj   | 378 252             | 0,17                    |
| 11 728 Enagas SA  | 207 586             | 0,09                    |
| 14 566 Endesa SA  | 291 320             | 0,13                    |
| 371 601 Enel SpA  | 2 090 999           | 0,95                    |
| 83 538 Engie SA   | 1 217 483           | 0,55                    |
| 114 271 Eni SpA   | 1 474 782           | 0,67                    |
| 15 708 Erste Group Bank AG  | 479 094             | 0,22                    |
| 13 233 EssilorLuxottica SA  | 2 196 678           | 0,99                    |
| 2 308 Eurazeo SE  | 151 174             | 0,07                    |
| 5 931 Eurofins Scientific SE                                      | 365 587             | 0,17                    |
| 3 845 Euronext NV   | 271 380             | 0,12                    |
| 9 065 Evonik Industries AG  | 175 498             | 0,08                    |

## SPDR MSCI EMU UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,51 % (mars 2022 : 99,51 %) (suite)</b> |                     |                         | <b>Valeurs mobilières – 99,51 % (mars 2022 : 99,51 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Actions ordinaires – 97,41 % (mars 2022 : 97,41 %) (suite)</b> |                     |                         | <b>Actions ordinaires – 97,41 % (mars 2022 : 97,41 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 97,03 % (suite)</b>                                     |                     |                         | <b>Euro – 97,03 % (suite)</b>                                     |                     |                         |
| 5 005 EXOR NV   | 379 579             | 0,17                    | 3 388 LEG Immobilien SE   | 171 026             | 0,08                    |
| 5 763 Ferrari NV  | 1 436 716           | 0,65                    | 12 222 Legrand SA   | 1 027 626           | 0,47                    |
| 22 545 Ferrovial SA   | 610 744             | 0,28                    | 11 029 L'Oreal SA   | 4 535 676           | 2,05                    |
| 28 076 FinecoBank Banca Fineco SpA                                | 396 995             | 0,18                    | 12 643 LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE                        | 10 675 749          | 4,83                    |
| 7 680 Flutter Entertainment PLC                                   | 1 287 552           | 0,58                    | 26 352 Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA                | 244 230             | 0,11                    |
| 20 517 Fortum Oyj   | 289 597             | 0,13                    | 36 656 Mercedes-Benz Group AG                                     | 2 594 512           | 1,17                    |
| 9 210 Fresenius Medical Care AG & Co KGaA                         | 360 111             | 0,16                    | 5 940 Merck KGaA  | 1 019 007           | 0,46                    |
| 19 412 Fresenius SE & Co KGaA                                     | 482 388             | 0,22                    | 30 324 Metso Outotec Oyj  | 304 453             | 0,14                    |
| 21 652 Galp Energia SGPS SA                                       | 226 480             | 0,10                    | 9 189 Moncler SpA   | 583 869             | 0,26                    |
| 6 939 GEA Group AG  | 291 091             | 0,13                    | 2 406 MTU Aero Engines AG   | 554 824             | 0,25                    |
| 20 612 Getlink SE   | 313 096             | 0,14                    | 6 396 Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen   | 2 062 710           | 0,93                    |
| 12 596 Grifols SA   | 114 724             | 0,05                    | 6 522 Naturgy Energy Group SA                                     | 180 986             | 0,08                    |
| 4 617 Groupe Bruxelles Lambert NV                                 | 362 435             | 0,16                    | 2 422 Nemetschek SE   | 153 264             | 0,07                    |
| 2 749 Hannover Rueck SE   | 495 782             | 0,22                    | 19 128 Neste Oyj  | 868 985             | 0,39                    |
| 6 653 HeidelbergCement AG   | 447 481             | 0,20                    | 29 513 Nexi SpA   | 220 934             | 0,10                    |
| 5 276 Heineken Holding NV   | 446 086             | 0,20                    | 13 331 NN Group NV  | 446 055             | 0,20                    |
| 11 837 Heineken NV  | 1 172 573           | 0,53                    | 247 434 Nokia Oyj   | 1 117 288           | 0,51                    |
| 7 238 HelloFresh SE   | 158 585             | 0,07                    | 4 832 OCI NV  | 151 048             | 0,07                    |
| 4 455 Henkel AG & Co KGaA (Voting rights)                         | 298 485             | 0,14                    | 6 807 OMV AG  | 287 664             | 0,13                    |
| 1 441 Hermes International  | 2 686 024           | 1,22                    | 91 262 Orange SA  | 999 501             | 0,45                    |
| 279 952 Iberdrola SA  | 3 215 249           | 1,46                    | 5 070 Orion Oyj   | 208 833             | 0,09                    |
| 2 595 IMCD NV   | 390 288             | 0,18                    | 9 444 Pernod Ricard SA  | 1 970 963           | 0,89                    |
| 49 901 Industria de Diseno Textil SA                              | 1 541 941           | 0,70                    | 22 184 Poste Italiane SpA   | 208 796             | 0,09                    |
| 59 663 Infineon Technologies                                      | 2 248 102           | 1,02                    | 38 060 Prosus NV  | 2 738 036           | 1,24                    |
| 15 364 Infrastrutture Wireless Italiane SpA                       | 186 212             | 0,08                    | 12 185 Prysmian SpA   | 471 560             | 0,21                    |
| 171 926 ING Groep NV  | 1 879 151           | 0,85                    | 10 213 Publicis Groupe SA   | 733 089             | 0,33                    |
| 766 477 Intesa Sanpaolo SpA                                       | 1 814 634           | 0,82                    | 4 614 Puma SE   | 262 352             | 0,12                    |
| 1 569 Ipsen SA  | 159 254             | 0,07                    | 10 069 QIAGEN NV  | 421 992             | 0,19                    |
| 4 541 JDE Peet's NV   | 121 790             | 0,06                    | 5 476 Randstad NV   | 298 990             | 0,14                    |
| 12 700 Jeronimo Martins SGPS SA                                   | 274 574             | 0,12                    | 220 Rational AG   | 135 740             | 0,06                    |
| 7 691 Just Eat Takeaway.com NV                                    | 134 823             | 0,06                    | 5 595 Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA              | 217 981             | 0,10                    |
| 11 538 KBC Group NV   | 730 355             | 0,33                    | 19 694 Red Electrica Corp SA                                      | 319 043             | 0,14                    |
| 3 402 Kering SA   | 2 041 200           | 0,92                    | 1 077 Remy Cointreau  | 180 936             | 0,08                    |
| 7 307 Kerry Group PLC   | 671 075             | 0,30                    | 9 413 Renault SA  | 353 929             | 0,16                    |
| 11 825 Kesko Oyj  | 234 194             | 0,11                    | 62 967 Repsol SA  | 893 187             | 0,40                    |
| 7 006 Kingspan Group  | 441 658             | 0,20                    | 1 975 Rheinmetall AG  | 540 360             | 0,24                    |
| 3 331 Knorr-Bremse AG   | 204 124             | 0,09                    | 29 391 RWEE AG  | 1 165 059           | 0,53                    |
| 15 373 Kone Oyj   | 737 904             | 0,33                    | 15 613 Safran SA  | 2 131 799           | 0,97                    |
| 47 682 Koninklijke Ahold Delhaize NV                              | 1 501 506           | 0,68                    | 21 742 Sampo Oyj  | 945 342             | 0,43                    |
| 7 981 Koninklijke DSM NV  | 867 535             | 0,39                    | 52 143 Sanofi   | 5 226 814           | 2,37                    |
| 155 079 Koninklijke KPN NV  | 504 937             | 0,23                    | 47 715 SAP SE   | 5 537 803           | 2,51                    |
| 40 121 Koninklijke Philips NV                                     | 675 477             | 0,31                    |   |                     |                         |
| 4 345 La Francaise des Jeux SAEM                                  | 166 805             | 0,08                    |   |                     |                         |

## SPDR MSCI EMU UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,51 % (mars 2022 : 99,51 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Actions ordinaires – 97,41 % (mars 2022 : 97,41 %) (suite)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 97,03 % (suite)</b>                                     |                     |                         |
| 1 218 Sartorius Stedim Biotech                                    | 343 476             | 0,16                    |
| 24 711 Schneider Electric SE (France listing)                     | 3 797 586           | 1,72                    |
| 3 739 Scout24 SE  | 204 523             | 0,09                    |
| 1 242 SEB SA  | 130 162             | 0,06                    |
| 34 947 Siemens AG   | 5 216 189           | 2,36                    |
| 20 354 Siemens Energy AG  | 411 965             | 0,19                    |
| 12 749 Siemens Healthineers AG                                    | 675 952             | 0,31                    |
| 11 752 Smurfit Kappa Group PLC                                    | 391 694             | 0,18                    |
| 95 197 Snam SpA   | 465 418             | 0,21                    |
| 36 468 Societe Generale SA  | 757 987             | 0,34                    |
| 4 079 Sodexo SA   | 367 355             | 0,17                    |
| 672 Sofina SA   | 138 701             | 0,06                    |
| 3 424 Solvay SA   | 360 718             | 0,16                    |
| 102 868 Stellantis NV   | 1 721 599           | 0,78                    |
| 30 905 STMicroelectronics NV                                      | 1 512 954           | 0,69                    |
| 25 473 Stora Enso Oyj   | 305 167             | 0,14                    |
| 6 204 Symrise AG  | 621 641             | 0,28                    |
| 538 548 Telecom Italia SpA/Milano                                 | 163 826             | 0,07                    |
| 52 353 Telefonica Deutschland Holding AG                          | 148 525             | 0,07                    |
| 237 704 Telefonica SA   | 944 398             | 0,43                    |
| 2 704 Teleperformance   | 599 477             | 0,27                    |
| 21 799 Tenaris SA   | 285 567             | 0,13                    |
| 62 586 Terna - Rete Elettrica Nazionale                           | 473 526             | 0,21                    |
| 4 935 Thales SA   | 672 887             | 0,30                    |
| 113 683 TotalEnergies SE  | 6 179 808           | 2,80                    |
| 5 696 UCB SA  | 469 578             | 0,21                    |
| 9 572 Umicore SA  | 298 742             | 0,14                    |
| 87 588 UniCredit SpA  | 1 524 907           | 0,69                    |
| 4 304 United Internet AG  | 68 304              | 0,03                    |
| 33 203 Universal Music Group NV                                   | 773 796             | 0,35                    |
| 24 222 UPM-Kymmene Oyj  | 749 671             | 0,34                    |
| 10 498 Valeo  | 198 517             | 0,09                    |
| 30 412 Veolia Environnement SA                                    | 863 701             | 0,39                    |
| 3 008 Verbund AG  | 240 640             | 0,11                    |
| 24 502 Vinci SA   | 2 590 351           | 1,17                    |
| 32 583 Vivendi SE   | 303 022             | 0,14                    |
| 5 213 voestalpine AG  | 163 063             | 0,07                    |
| 1 412 Volkswagen AG (Voting rights)                               | 223 096             | 0,10                    |
| 32 498 Vonovia SE   | 563 515             | 0,26                    |
| 20 636 Wartsila OYJ Abp   | 179 286             | 0,08                    |
| 1 142 Wendel SE   | 111 174             | 0,05                    |
| 12 016 Wolters Kluwer NV  | 1 398 062           | 0,63                    |
| 10 464 Worldline SA/France  | 409 247             | 0,19                    |

| Participation Investissement   | Juste valeur<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|--|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,51 % (mars 2022 : 99,51 %) (suite)</b>                  |                     |                         |
| <b>Actions ordinaires – 97,41 % (mars 2022 : 97,41 %) (suite)</b>                  |                     |                         |
| <b>Euro – 97,03 % (suite)</b>  |                     |                         |
| 9 872 Zalando SE   | 380 467             | 0,17                    |
|  | <b>214 343 948</b>  | <b>97,03</b>            |
| <b>Dollar américain – 0,38 %</b>   |                     |                         |
| 6 008 AerCap Holdings NV   | 310 948             | 0,14                    |
| 9 681 Coca-Cola Europacific Partners PLC   | 527 423             | 0,24                    |
|  | <b>838 371</b>      | <b>0,38</b>             |
| <b>Total des actions ordinaires</b>  |                     |                         |
|  | <b>215 182 319</b>  | <b>97,41</b>            |
| <b>Certificats représentatifs de titres – 0,12 % (mars 2022 : 0,10 %)</b>          |                     |                         |
| <b>Euro – 0,12 %</b>   |                     |                         |
| 17 860 ABN AMRO Bank NV  | 261 113             | 0,12                    |
| <b>Total des certificats représentatifs de titres</b>                              |                     |                         |
|  | <b>261 113</b>      | <b>0,12</b>             |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 0,46 % (mars 2022 : 0,49 %)</b> |                     |                         |
| <b>Euro – 0,46 %</b>   |                     |                         |
| 2 224 Covivio  | 119 206             | 0,05                    |
| 2 306 Gecina SA  | 220 338             | 0,10                    |
| 9 837 Klepierre SA   | 205 102             | 0,09                    |
| 5 464 Unibail-Rodamco-Westfield  | 269 840             | 0,12                    |
| 7 652 Warehouses De Pauw CVA   | 209 053             | 0,10                    |
| <b>Total des fiducies de placement immobilier de type REIT</b>                     |                     |                         |
|  | <b>1 023 539</b>    | <b>0,46</b>             |
| <b>Actions préférentielles – 1,52 % (mars 2022 : 1,51 %)</b>                       |                     |                         |
| <b>Euro – 1,52 %</b>   |                     |                         |
| 2 768 Bayerische Motoren Werke AG (Non voting rights)                              | 261 022             | 0,12                    |
| 5 219 Dr. Ing. h.c. F.Porsche  | 615 842             | 0,28                    |
| 8 460 Henkel AG & Co KGaA (Non voting rights)                                      | 609 628             | 0,28                    |
| 6 923 Porsche Automobil Holding SE   | 366 365             | 0,17                    |
| 1 098 Sartorius  | 424 926             | 0,19                    |
| 8 479 Volkswagen AG (Non voting rights)  | 1 065 302           | 0,48                    |
| <b>Total des actions préférentielles</b>   |                     |                         |
|  | <b>3 343 085</b>    | <b>1,52</b>             |
| <b>Droits – Néant (mars 2022 : 0,00 %)</b>   |                     |                         |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>  |                     |                         |
|  | <b>219 810 056</b>  | <b>99,51</b>            |



## SPDR MSCI EMU UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

Instruments financiers dérivés – 0,00 % (mars 2022 : 0,01 %)

Contrats à terme standardisés – 0,00 % (mars 2022 : 0,01 %)

| Montant<br>notionnel | Prix<br>du coût<br>moyen   | Plus-values<br>latentes<br>EUR | % des<br>actifs<br>nets |
|----------------------|--|--------------------------------|-------------------------|
| 165 880              | 4 147 4 of Euro STOXX 50<br>Index Futures Long<br>Futures Contracts<br>Expiring 16 June 2023 | 4 560                          | 0,00                    |
|                      | <b>Plus-values latentes nettes sur<br/>contrats à terme standardisés</b>                     | <b>4 560</b>                   | <b>0,00</b>             |
|                      | <b>Total des instruments financiers<br/>dérivés</b>  | <b>4 560</b>                   | <b>0,00</b>             |

|   | Juste valeur<br>EUR | % du<br>Comp. |
|---|---------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | 219 814 616         | 99,51         |
| <b>Disponibilités bancaires*</b><br>(mars 2022 : 0,16 %)                                    | 186 125             | 0,08          |
| <b>Liquidités détenues auprès d'un<br/>courtier*</b> (mars 2022 : 0,01 %)                   | 11 707              | 0,01          |
| <b>Autres actifs nets</b><br>(mars 2022 : 0,31 %)   | 885 303             | 0,40          |
| <b>Actifs nets attribuables aux<br/>porteurs d'actions de participation<br/>rachetables</b> | <b>220 897 751</b>  | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company, à l'exception des liquidités détenues auprès d'un courtier, en l'occurrence Goldman Sachs.

Le courtier pour les contrats à terme standardisés ouverts est Goldman Sachs.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

| <b>Analyse du total des actifs (non audité)</b>                         | <b>% du<br/>total<br/>des actifs</b> |
|---|--------------------------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs | 99,49                                |
| Instruments financiers dérivés négociés en Bourse                       | 0,00                                 |
| Autres actifs   | 0,51                                 |
| <b>Total des actifs</b>   | <b>100,00</b>                        |

## SPDR MSCI Japan UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>JPY           | 2022<br>JPY           |
|--|-------|-----------------------|-----------------------|
| <b>Actifs circulants</b>   |       |                       |                       |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                         | 1(e)  |                       |                       |
| Valeurs mobilières   |       | 40 457 487 131        | 32 719 968 598        |
| Instruments financiers dérivés   |       | 19 302 514            | 101 121 080           |
|  |       | <b>40 476 789 645</b> | <b>32 821 089 678</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie  | 1(f)  | 95 243 436            | 201 435 477           |
| Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties à des instruments financiers ouverts | 1(g)  | 5 661 500             | -                     |
| Créances :   |       |                       |                       |
| Dividendes à recevoir  |       | 391 626 630           | 291 529 641           |
| À recevoir sur cessions d'actions de fonds   |       | -                     | 375 287 463           |
| <b>Total des actifs circulants</b>   |       | <b>40 969 321 211</b> | <b>33 689 342 259</b> |
| <b>Passifs circulants</b>  |       |                       |                       |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                        | 1(e)  |                       |                       |
| Instruments financiers dérivés   |       | (2 150 158)           | (5 916 121)           |
| Liquidités dues aux courtiers et aux contreparties pour des instruments financiers ouverts       | 1(g)  | -                     | (9 631 450)           |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :   |       |                       |                       |
| Charges à payer  |       | (4 128 754)           | (3 294 087)           |
| À payer sur achats d'investissements   |       | -                     | (371 323 500)         |
| <b>Total des passifs circulants</b>  |       | <b>(6 278 912)</b>    | <b>(390 165 158)</b>  |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>              |       | <b>40 963 042 299</b> | <b>33 299 177 101</b> |
|  |       | <b>2023</b>           | <b>2022</b>           |
|  |       | <b>2021</b>           |                       |
| Valeur liquidative par action  |       |                       |                       |
| Catégorie couverte en EUR  | 5     | 47,00 EUR             | 44,93 EUR             |
| Catégorie non couverte en JPY  | 5     | 6 491,14 JPY          | 6 254,79 JPY          |
|  |       | 6 103,25 JPY          |                       |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR MSCI Japan UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>JPY          | 2022<br>JPY        |
|---|-------|----------------------|--------------------|
| Produits de dividendes  |       | 1 034 985 121        | 661 168 177        |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat    | 9     | 868 392 843          | (160 547 023)      |
| Produits divers   |       | 112 143              | -                  |
| <b>Total des produits d'investissement</b>  |       | <b>1 903 490 107</b> | <b>500 621 154</b> |
| Charges opérationnelles   | 3     | (46 136 141)         | (32 923 542)       |
| <b>Bénéfice net pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>   |       | <b>1 857 353 966</b> | <b>467 697 612</b> |
| <b>Charges financières</b>  |       |                      |                    |
| Charges d'intérêts  |       | (1 451 517)          | (1 238 688)        |
| <b>Bénéfice pour l'exercice financier avant impôt</b>   |       | <b>1 855 902 449</b> | <b>466 458 924</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement   | 2     | (155 229 685)        | (98 868 848)       |
| <b>Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>1 700 672 764</b> | <b>367 590 076</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR MSCI Japan UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>JPY           | 2022<br>JPY           |
|---|-----------------------|-----------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier                 | 33 299 177 101        | 11 561 861 863        |
| <b>Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>1 700 672 764</b>  | <b>367 590 076</b>    |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                       |                       |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 10 391 108 988        | 33 771 897 396        |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (4 427 916 554)       | (12 402 172 234)      |
| Augmentation des actifs nets résultant d'opérations sur actions   | 5 963 192 434         | 21 369 725 162        |
| <b>Augmentation totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                   | <b>7 663 865 198</b>  | <b>21 737 315 238</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>          | <b>40 963 042 299</b> | <b>33 299 177 101</b> |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR MSCI Japan UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

| Notes   | 2023<br>JPY            | 2022<br>JPY             |
|---|------------------------|-------------------------|
| <b>Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant d'opérations</b> | <b>1 700 672 764</b>   | <b>367 590 076</b>      |
| <b>Ajustement pour :</b>  |                        |                         |
| Variation de la trésorerie détenue par/à payer au courtier  | (15 292 950)           | 10 676 589              |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | (8 108 842 033)        | (20 895 122 219)        |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés   | 78 052 603             | (93 017 316)            |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   | <b>(6 345 409 616)</b> | <b>(20 609 872 870)</b> |
| Variation des montants à recevoir   | (100 096 989)          | (204 138 899)           |
| Variation des montants à payer  | 834 667                | 2 120 201               |
| <b>Sorties de trésorerie sur opérations</b>   | <b>(99 262 322)</b>    | <b>(202 018 698)</b>    |
| <b>Sorties de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  | <b>(6 444 671 938)</b> | <b>(20 811 891 568)</b> |
| <b>Activités de financement</b>   |                        |                         |
| Produits des souscriptions  | 5 10 766 396 451       | 33 396 609 933          |
| Paiements sur rachats   | 5 (4 427 916 554)      | (12 402 172 234)        |
| <b>Trésorerie nette générée sur activités de financement</b>  | <b>6 338 479 897</b>   | <b>20 994 437 699</b>   |
| <b>(Diminution)/Augmentation nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>                                    | <b>(106 192 041)</b>   | <b>182 546 131</b>      |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  | 201 435 477            | 18 889 346              |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   | <b>95 243 436</b>      | <b>201 435 477</b>      |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |                        |                         |
| Impôts payés  | (155 229 685)          | (98 868 848)            |
| Intérêts payés  | (1 451 517)            | (1 238 688)             |
| Dividendes reçus  | 934 888 132            | 457 029 278             |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR MSCI Japan UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                              | Juste valeur JPY | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,77 % (mars 2022 : 98,26 %)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,73 % (mars 2022 : 96,93 %)</b> |                  |                   |
| <b>Yen japonais – 97,73 %</b>                             |                  |                   |
| 16 700 Advantest Corp                                     | 203 072 000      | 0,50              |
| 60 669 Aeon Co Ltd  | 155 676 654      | 0,38              |
| 18 317 AGC Inc  | 90 211 225       | 0,22              |
| 14 323 Aisin Corp   | 52 207 335       | 0,13              |
| 41 433 Ajinomoto Co Inc                                   | 190 840 398      | 0,47              |
| 15 438 ANA Holdings Inc                                   | 44 399 688       | 0,11              |
| 42 961 Asahi Group Holdings Ltd                           | 211 539 964      | 0,52              |
| 19 000 Asahi Intecc Co Ltd                                | 44 156 000       | 0,11              |
| 118 367 Asahi Kasei Corp                                  | 109 643 352      | 0,27              |
| 170 471 Astellas Pharma                                   | 320 996 893      | 0,78              |
| 11 400 Azbil  | 41 154 000       | 0,10              |
| 55 716 Bandai Namco Holdings Inc                          | 158 707 026      | 0,39              |
| 11 100 BayCurrent Consulting Inc                          | 60 495 000       | 0,15              |
| 51 957 Bridgestone Corp                                   | 278 853 219      | 0,68              |
| 22 891 Brother Industries Ltd                             | 45 598 872       | 0,11              |
| 93 229 Canon Inc  | 275 538 310      | 0,67              |
| 14 800 Capcom Co Ltd                                      | 70 078 000       | 0,17              |
| 13 149 Central Japan Railway Co                           | 207 885 690      | 0,51              |
| 45 646 Chiba Bank Ltd                                     | 39 027 330       | 0,10              |
| 57 533 Chubu Electric Power Co Inc                        | 80 488 667       | 0,20              |
| 61 838 Chugai Pharmaceutical Co Ltd                       | 202 210 260      | 0,49              |
| 94 800 Concordia Financial Group Ltd                      | 46 262 400       | 0,11              |
| 41 000 CyberAgent Inc                                     | 45 715 000       | 0,11              |
| 19 727 Dai Nippon Printing Co Ltd                         | 73 088 535       | 0,18              |
| 28 200 Daifuku Co Ltd                                     | 68 892 600       | 0,17              |
| 89 671 Dai-ichi Life Holdings Inc                         | 218 348 885      | 0,53              |
| 161 627 Daiichi Sankyo Co Ltd                             | 779 365 394      | 1,90              |
| 23 111 Daikin Industries Ltd                              | 546 690 705      | 1,33              |
| 5 918 Daito Trust Construction Co Ltd                     | 78 058 420       | 0,19              |
| 55 565 Daiwa House Industry Co Ltd                        | 173 029 410      | 0,42              |
| 125 976 Daiwa Securities Group Inc                        | 78 231 096       | 0,19              |
| 39 836 Denso Corp   | 296 499 348      | 0,72              |
| 19 316 Dentsu Group Inc                                   | 89 819 400       | 0,22              |
| 8 220 Disco Corp  | 125 766 000      | 0,31              |
| 28 160 East Japan Railway Co                              | 206 553 600      | 0,50              |
| 23 351 Eisai Co Ltd                                       | 175 225 904      | 0,43              |
| 284 507 ENEOS Holdings Inc                                | 132 352 656      | 0,32              |
| 87 895 FANUC Corp   | 418 380 200      | 1,02              |
| 16 310 Fast Retailing Co Ltd                              | 471 032 800      | 1,15              |
| 11 523 Fuji Electric Co Ltd                               | 59 919 600       | 0,15              |
| 33 649 FUJIFILM Holdings Corp                             | 225 381 002      | 0,55              |
| 18 064 Fujitsu Ltd  | 322 171 440      | 0,79              |
| 3 980 GMO Payment Gateway Inc                             | 45 292 400       | 0,11              |
| 19 982 Hakuholdo DY Holdings Inc                          | 29 873 090       | 0,07              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur JPY | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,77 % (mars 2022 : 98,26 %)</b>         |                  |                   |
| <b>(suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,73 % (mars 2022 : 96,93 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Yen japonais – 97,73 % (suite)</b>                             |                  |                   |
| 13 237 Hamamatsu Photonics KK                                     | 94 115 070       | 0,23              |
| 21 400 Hankyu Hanshin Holdings Inc                                | 83 995 000       | 0,21              |
| 1 672 Hikari Tsushin Inc  | 31 049 040       | 0,08              |
| 2 672 Hirose Electric Co Ltd                                      | 46 145 440       | 0,11              |
| 9 905 Hitachi Construction Machinery Co Ltd                       | 30 457 875       | 0,07              |
| 89 751 Hitachi Ltd  | 650 874 252      | 1,59              |
| 150 956 Honda Motor Co Ltd  | 529 855 560      | 1,29              |
| 9 700 Hoshizaki Corp  | 47 384 500       | 0,12              |
| 33 172 Hoya Corp  | 482 984 320      | 1,18              |
| 32 525 Hulic Co Ltd   | 35 354 675       | 0,09              |
| 9 800 Ibiben Co Ltd   | 51 548 000       | 0,13              |
| 18 983 Idemitsu Kosan Co Ltd                                      | 55 050 700       | 0,13              |
| 12 455 Iida Group Holdings Co Ltd                                 | 26 890 345       | 0,07              |
| 94 191 Inpex Corp   | 131 584 827      | 0,32              |
| 54 244 Isuzu Motors Ltd   | 85 651 276       | 0,21              |
| 110 167 ITOCHU Corp   | 473 828 267      | 1,16              |
| 8 000 Itochu Techno-Solutions                                     | 26 040 000       | 0,06              |
| 12 353 Japan Airlines Co Ltd                                      | 31 895 446       | 0,08              |
| 47 673 Japan Exchange Group Inc                                   | 96 227 951       | 0,24              |
| 130 530 Japan Post Bank Co Ltd                                    | 141 363 990      | 0,35              |
| 219 101 Japan Post Holdings Co Ltd                                | 235 862 227      | 0,58              |
| 19 696 Japan Post Insurance Co Ltd                                | 40 711 632       | 0,10              |
| 111 055 Japan Tobacco Inc   | 310 731 890      | 0,76              |
| 41 657 JFE Holdings Inc   | 69 942 103       | 0,17              |
| 16 720 JSR Corp   | 52 082 800       | 0,13              |
| 39 297 Kajima Corp  | 62 796 606       | 0,15              |
| 68 058 Kansai Electric Power Co Inc                               | 87 862 878       | 0,21              |
| 43 805 Kao Corp   | 226 340 435      | 0,55              |
| 149 206 KDDI Corp   | 610 700 158      | 1,49              |
| 9 736 Keio Corp   | 45 223 720       | 0,11              |
| 11 620 Keisei Electric Railway                                    | 47 351 500       | 0,12              |
| 17 993 Keyence  | 1 159 648 850    | 2,83              |
| 13 355 Kikkoman Corp  | 90 012 700       | 0,22              |
| 15 584 Kintetsu Group Holdings Co Ltd                             | 66 465 760       | 0,16              |
| 76 308 Kirin Holdings Co Ltd                                      | 159 941 568      | 0,39              |
| 4 400 Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd                             | 35 596 000       | 0,09              |
| 14 401 Kobe Bussan Co Ltd   | 53 067 685       | 0,13              |
| 10 388 Koei Tecmo Holdings Co Ltd                                 | 24 806 544       | 0,06              |
| 19 392 Koito Manufacturing  | 48 480 000       | 0,12              |
| 85 686 Komatsu Ltd  | 280 793 022      | 0,69              |
| 8 693 Konami Group Corp   | 52 766 510       | 0,13              |
| 2 921 Kose Corp   | 45 801 280       | 0,11              |
| 93 336 Kubota Corp  | 186 578 664      | 0,46              |

## SPDR MSCI Japan UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur JPY | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur JPY | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,77 % (mars 2022 : 98,26 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 98,77 % (mars 2022 : 98,26 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,73 % (mars 2022 : 96,93 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 97,73 % (mars 2022 : 96,93 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Yen japonais – 97,73 % (suite)</b>                             |                  |                   | <b>Yen japonais – 97,73 % (suite)</b>                             |                  |                   |
| 9 505 Kunita Water Industries                                     | 57 410 200       | 0,14              | 220 090 Nissan Motor Co Ltd                                       | 110 287 099      | 0,27              |
| 29 512 Kyocera  | 203 278 656      | 0,50              | 18 504 Nisshin Seifun Group Inc                                   | 28 699 704       | 0,07              |
| 23 770 Kyowa Kirin Co Ltd   | 68 600 220       | 0,17              | 5 843 Nissin Foods Holdings Co Ltd                                | 70 875 590       | 0,17              |
| 7 010 Lasertec Corp   | 163 192 800      | 0,40              | 7 579 Nitori Holdings Co Ltd                                      | 120 733 470      | 0,29              |
| 27 005 Lixil Corp   | 58 789 885       | 0,14              | 13 424 Nitto Denko Corp   | 114 775 200      | 0,28              |
| 40 164 M3 Inc   | 132 581 364      | 0,32              | 268 416 Nomura Holdings Inc                                       | 136 811 635      | 0,33              |
| 21 800 Makita Corp  | 71 504 000       | 0,17              | 11 271 Nomura Real Estate Holdings Inc                            | 33 024 030       | 0,08              |
| 142 737 Marubeni Corp   | 256 284 284      | 0,63              | 35 600 Nomura Research Institute Ltd                              | 109 114 000      | 0,27              |
| 9 700 MatsukiyoCocokara & Co                                      | 67 997 000       | 0,17              | 59 285 NTT Data Corp  | 102 681 620      | 0,25              |
| 50 440 Mazda Motor Corp   | 61 789 000       | 0,15              | 57 954 Obayashi Corp  | 58 707 402       | 0,14              |
| 7 352 McDonald's Holdings Co Japan Ltd                            | 40 583 040       | 0,10              | 6 252 Obic Co Ltd   | 130 666 800      | 0,32              |
| 22 724 MEIJI Holdings Co Ltd                                      | 71 694 220       | 0,18              | 26 583 Odakyu Electric Railway Co Ltd                             | 45 722 760       | 0,11              |
| 34 806 MINEBEA MITSUMI Inc  | 87 397 866       | 0,21              | 70 115 Oji Holdings Corp  | 36 740 260       | 0,09              |
| 27 000 MISUMI Group Inc   | 89 100 000       | 0,22              | 114 640 Olympus   | 265 792 840      | 0,65              |
| 122 321 Mitsubishi Chemical Group Corp                            | 96 107 610       | 0,23              | 17 738 Omron  | 136 706 766      | 0,33              |
| 115 506 Mitsubishi Corp   | 548 769 006      | 1,34              | 31 300 Ono Pharmaceutical   | 86 513 200       | 0,21              |
| 178 699 Mitsubishi Electric Corp                                  | 282 076 372      | 0,69              | 7 800 Open House Group Co Ltd                                     | 38 610 000       | 0,09              |
| 107 025 Mitsubishi Estate Co Ltd                                  | 168 724 913      | 0,41              | 3 701 Oracle Corp Japan   | 35 270 530       | 0,09              |
| 57 560 Mitsubishi HC Capital Inc                                  | 39 371 040       | 0,10              | 92 685 Oriental Land Co Ltd/Japan                                 | 419 677 680      | 1,02              |
| 29 946 Mitsubishi Heavy Industries Ltd                            | 146 016 696      | 0,36              | 110 201 ORIX  | 239 852 477      | 0,59              |
| 1 103 962 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc                      | 936 049 380      | 2,29              | 35 516 Osaka Gas Co Ltd   | 77 460 396       | 0,19              |
| 130 947 Mitsui & Co Ltd   | 538 977 852      | 1,32              | 10 896 Otsuka Corp  | 51 047 760       | 0,12              |
| 17 217 Mitsui Chemicals Inc                                       | 58 709 970       | 0,14              | 36 376 Otsuka Holdings Co Ltd                                     | 152 888 328      | 0,37              |
| 83 358 Mitsui Fudosan   | 207 061 272      | 0,51              | 35 888 Pan Pacific International Holdings Corp                    | 91 837 392       | 0,22              |
| 31 200 Mitsui OSK Lines Ltd                                       | 103 272 000      | 0,25              | 206 037 Panasonic Holdings Corp                                   | 243 535 734      | 0,59              |
| 222 145 Mizuho Financial Group Inc                                | 417 188 310      | 1,02              | 16 000 Persol Holdings Co Ltd                                     | 42 464 000       | 0,10              |
| 22 200 MonotaRO Co Ltd  | 36 785 400       | 0,09              | 76 110 Rakuten  | 46 731 540       | 0,11              |
| 40 314 MS&AD Insurance Group Holdings Inc                         | 165 529 284      | 0,40              | 133 602 Recruit Holdings Co Ltd                                   | 487 647 300      | 1,19              |
| 52 695 Murata Manufacturing Co Ltd                                | 423 667 800      | 1,03              | 104 800 Renesas Electronics Corp                                  | 200 534 800      | 0,49              |
| 22 100 NEC  | 112 710 000      | 0,28              | 203 140 Resona Holdings Inc                                       | 129 908 030      | 0,32              |
| 43 472 Nexon Co Ltd   | 137 154 160      | 0,33              | 50 573 Ricoh Co Ltd   | 50 117 843       | 0,12              |
| 22 590 NGK Insulators   | 39 577 680       | 0,10              | 8 363 Rohm Co Ltd   | 91 742 110       | 0,22              |
| 41 080 Nidec Corp   | 281 192 600      | 0,69              | 23 307 SBI Holdings Inc   | 61 157 568       | 0,15              |
| 27 000 Nihon M&A Center Holdings Inc                              | 26 568 000       | 0,07              | 13 700 SCSK Corp  | 26 509 500       | 0,06              |
| 102 024 Nintendo Co Ltd   | 523 485 144      | 1,28              | 19 792 Secom Co Ltd   | 161 581 888      | 0,39              |
| 7 213 Nippon Express Holdings Inc                                 | 57 487 610       | 0,14              | 24 256 Seiko Epson Corp   | 45 625 536       | 0,11              |
| 75 260 Nippon Paint Holdings Co Ltd                               | 93 171 880       | 0,23              | 32 472 Sekisui Chemical   | 60 917 472       | 0,15              |
| 16 173 Nippon Sanso Holdings Corp                                 | 38 524 086       | 0,09              | 56 877 Sekisui House Ltd  | 153 454 146      | 0,37              |
| 4 300 Nippon Shinyaku Co Ltd                                      | 25 069 000       | 0,06              | 69 347 Seven & i Holdings Co Ltd                                  | 414 348 325      | 1,01              |
| 74 671 Nippon Steel Corp  | 232 973 520      | 0,57              | 28 500 SG Holdings Co Ltd   | 55 860 000       | 0,14              |
| 111 264 Nippon Telegraph & Telephone Corp                         | 440 827 968      | 1,08              | 19 200 Sharp Corp/Japan   | 17 913 600       | 0,04              |
| 45 130 Nippon Yusen KK  | 139 406 570      | 0,34              | 21 651 Shimadzu Corp  | 89 635 140       | 0,22              |
| 11 400 Nissan Chemical Corp                                       | 68 286 000       | 0,17              | 6 732 Shimano Inc   | 153 758 880      | 0,38              |

## SPDR MSCI Japan UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur JPY | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,77 % (mars 2022 : 98,26 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,73 % (mars 2022 : 96,93 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Yen japonais – 97,73 % (suite)</b>                             |                  |                   |
| 49 135 Shimizu Corp   | 36 851 250       | 0,09              |
| 170 550 Shin-Etsu Chemical Co Ltd                                 | 729 101 250      | 1,78              |
| 24 628 Shionogi & Co Ltd  | 147 201 556      | 0,36              |
| 37 259 Shiseido   | 230 297 879      | 0,56              |
| 39 210 Shizuoka Financial Group Inc                               | 37 288 710       | 0,09              |
| 5 299 SMC Corp  | 370 029 170      | 0,90              |
| 263 195 SoftBank Corp   | 402 425 155      | 0,98              |
| 111 382 SoftBank Group  | 577 181 524      | 1,41              |
| 28 654 Sompo Holdings Inc   | 150 490 808      | 0,37              |
| 116 267 Sony  | 1 393 459 995    | 3,40              |
| 7 338 Square Enix Holdings Co Ltd                                 | 46 669 680       | 0,11              |
| 57 117 Subaru Corp  | 120 773 897      | 0,29              |
| 30 500 SUMCO Corp   | 60 420 500       | 0,15              |
| 131 528 Sumitomo Chemical Co Ltd                                  | 58 529 960       | 0,14              |
| 103 751 Sumitomo Corp   | 242 881 091      | 0,59              |
| 66 050 Sumitomo Electric Industries Ltd                           | 112 086 850      | 0,27              |
| 22 733 Sumitomo Metal Mining                                      | 114 778 917      | 0,28              |
| 121 206 Sumitomo Mitsui Financial Group Inc                       | 642 149 388      | 1,57              |
| 30 553 Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc                         | 138 741 173      | 0,34              |
| 29 150 Sumitomo Realty & Development Co Ltd                       | 86 925 300       | 0,21              |
| 12 025 Suntory Beverage & Food Ltd                                | 59 343 375       | 0,15              |
| 33 877 Suzuki Motor Corp  | 162 745 108      | 0,40              |
| 15 449 Sysmex Corp  | 133 525 707      | 0,33              |
| 48 387 T&D Holdings Inc   | 79 403 067       | 0,19              |
| 16 796 Taisei Corp  | 68 779 620       | 0,17              |
| 139 285 Takeda Pharmaceutical Co Ltd                              | 605 889 750      | 1,48              |
| 36 295 TDK  | 171 493 875      | 0,42              |
| 59 192 Terumo   | 211 552 208      | 0,52              |
| 21 500 TIS Inc  | 75 035 000       | 0,18              |
| 17 971 Tobu Railway Co Ltd  | 56 968 070       | 0,14              |
| 10 400 Toho Co Ltd/Tokyo  | 52 728 000       | 0,13              |
| 168 522 Tokio Marine Holdings Inc                                 | 429 225 534      | 1,05              |
| 134 163 Tokyo Electric Power Co Holdings Inc                      | 63 459 099       | 0,16              |
| 41 658 Tokyo Electron Ltd   | 668 194 320      | 1,63              |
| 36 120 Tokyo Gas Co Ltd   | 90 155 520       | 0,22              |

Instruments financiers dérivés – 0,04 % (mars 2022 : 0,29 %)

Contrats de change à terme – 0,03 % (mars 2022 : 0,24 %)

| Participation Investissement   | Juste valeur JPY      | % des actifs nets |
|--|-----------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,77 % (mars 2022 : 98,26 %) (suite)</b>                  |                       |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,73 % (mars 2022 : 96,93 %) (suite)</b>                  |                       |                   |
| <b>Yen japonais – 97,73 % (suite)</b>  |                       |                   |
| 49 024 Tokyu Corp  | 86 380 288            | 0,21              |
| 23 190 TOPPAN INC  | 61 801 350            | 0,15              |
| 132 047 Toray Industries Inc   | 99 880 351            | 0,24              |
| 35 120 Toshiba Corp  | 156 108 400           | 0,38              |
| 23 000 Tosoh Corp  | 41 331 000            | 0,10              |
| 13 634 TOTO Ltd  | 60 262 280            | 0,15              |
| 13 315 Toyota Industries Corp  | 97 865 250            | 0,24              |
| 976 700 Toyota Motor   | 1 836 196 000         | 4,48              |
| 19 101 Toyota Tsusho Corp  | 107 347 620           | 0,26              |
| 11 896 Trend Micro Inc/Japan   | 76 967 120            | 0,19              |
| 37 207 Unicharm Corp   | 202 443 287           | 0,49              |
| 19 428 USS Co Ltd  | 44 587 260            | 0,11              |
| 7 900 Welcia Holdings Co Ltd   | 22 388 600            | 0,05              |
| 20 521 West Japan Railway Co   | 111 983 097           | 0,27              |
| 11 633 Yakult Honsha Co Ltd  | 112 025 790           | 0,27              |
| 13 133 Yamaha Corp   | 66 846 970            | 0,16              |
| 25 690 Yamaha Motor Co Ltd   | 88 887 400            | 0,22              |
| 26 284 Yamato Holdings Co Ltd  | 59 638 396            | 0,15              |
| 21 694 Yaskawa Electric  | 125 174 380           | 0,31              |
| 19 761 Yokogawa Electric   | 42 486 150            | 0,10              |
| 254 276 Z Holdings Corp  | 94 794 093            | 0,23              |
| 11 500 ZOZO Inc  | 34 672 500            | 0,08              |
| <b>Total des actions ordinaires</b>  | <b>40 034 324 731</b> | <b>97,73</b>      |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 1,04 % (mars 2022 : 1,33 %)</b> |                       |                   |
| <b>Yen japonais – 1,04 %</b>   |                       |                   |
| 209 Daiwa House REIT Investment Corp   | 56 743 500            | 0,14              |
| 384 GLP J-Reit   | 54 950 400            | 0,13              |
| 615 Japan Metropolitan Fund Invest   | 59 470 500            | 0,15              |
| 115 Japan Real Estate Investment Corp  | 60 720 000            | 0,15              |
| 147 Nippon Building Fund Inc   | 80 997 000            | 0,20              |
| 190 Nippon Prologis REIT Inc   | 53 257 000            | 0,13              |
| 384 Nomura Real Estate Master Fund Inc   | 57 024 000            | 0,14              |
| <b>Total des fiducies de placement immobilier de type REIT</b>                     | <b>423 162 400</b>    | <b>1,04</b>       |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>  | <b>40 457 487 131</b> | <b>98,77</b>      |

| Devise achetée | Devise vendue | Montant acheté | Montant vendu | Date d'échéance | Contrepartie                | Plus-values/ (Moins-values) latentes JPY | % du Comp. |
|----------------|---------------|----------------|---------------|-----------------|-----------------------------|--|------------|
| EUR            | JPY           | 575 159        | 83 336 000    | 04/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (170 508)                                | (0,00)     |



## SPDR MSCI Japan UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

Instruments financiers dérivés – 0,04 % (mars 2022 : 0,29 %) (suite)

Contrats de change à terme – 0,03 % (mars 2022 : 0,24 %) (suite)

| Devise achetée  | Devise vendue | Montant acheté | Montant vendu | Date d'échéance | Contrepartie                | Plus-values/<br>(Moins-values)<br>latentes<br>JPY | % du<br>Comp. |
|---|---------------|----------------|---------------|-----------------|-----------------------------|---|---------------|
| EUR   | JPY           | 575 160        | 83 336 000    | 04/04/2023      | Barclays Bank               | (170 371)   | (0,00)        |
| EUR   | JPY           | 4 168 045      | 600 518 927   | 04/04/2023      | Merrill Lynch International | 2 162 073   | 0,01          |
| EUR   | JPY           | 4 168 085      | 600 518 927   | 04/04/2023      | State Street Bank           | 2 167 888   | 0,01          |
| EUR   | JPY           | 1 084 593      | 153 767 000   | 04/04/2023      | Barclays Bank               | 3 060 390   | 0,00          |
| EUR   | JPY           | 4 861 045      | 698 774 927   | 04/04/2023      | BNP Paribas                 | 4 110 808   | 0,01          |
| EUR   | JPY           | 5 202 545      | 748 014 927   | 04/04/2023      | Westpac Banking Corporation | 4 250 293   | 0,00          |
| JPY   | EUR           | 186 578 000    | 1 296 611     | 04/04/2023      | Westpac Banking Corporation | (906 308)   | (0,00)        |
| JPY   | EUR           | 75 168 000     | 525 017       | 04/04/2023      | Royal Bank of Canada        | (747 096)   | (0,00)        |
| JPY   | EUR           | 111 410 000    | 771 037       | 04/04/2023      | Barclays Bank               | (78 582)  | (0,00)        |
| JPY   | EUR           | 111 410 000    | 771 028       | 04/04/2023      | Merrill Lynch International | (77 293)  | (0,00)        |
| <b>Plus-values latentes sur contrats de change à terme</b>        |               |                |               |                 |                             | <b>15 751 452</b>                                 | <b>0,03</b>   |
| <b>Moins-values latentes sur contrats de change à terme</b>       |               |                |               |                 |                             | <b>(2 150 158)</b>                                | <b>(0,00)</b> |
| <b>Plus-values latentes nettes sur contrats de change à terme</b> |               |                |               |                 |                             | <b>13 601 294</b>                                 | <b>0,03</b>   |

Contrats à terme standardisés – 0,01 % (mars 2022 : 0,05 %)

| Montant notionnel  | Prix du coût moyen |  | Plus-values latentes JPY | % des actifs nets |
|--|--------------------|--|--------------------------|-------------------|
| 469 274 938  | 1 988              | 236 of Mini Topix Index Futures Long Futures Contracts Expiring 08 June 2023 | 3 551 062                | 0,01              |
| <b>Plus-values latentes nettes sur contrats à terme standardisés</b> |                    |  | <b>3 551 062</b>         | <b>0,01</b>       |
| <b>Total des instruments financiers dérivés</b>                      |                    |  | <b>17 152 356</b>        | <b>0,04</b>       |

|   | Juste valeur JPY      | % du Comp.    |
|---|-----------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | <b>40 474 639 487</b> | <b>98,81</b>  |
| Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,60 %)                                      | 95 243 436            | 0,23          |
| Liquidités détenues auprès d'un courtier* (mars 2022 : néant)                       | 5 661 500             | 0,01          |
| Montants à recevoir du courtier (mars 2022 : (0,03 %))                              | -                     | -             |
| Autres actifs nets (mars 2022 : 0,88 %)   | 387 497 876           | 0,95          |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>40 963 042 299</b> | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company, à l'exception des liquidités détenues auprès d'un courtier, en l'occurrence Goldman Sachs.

Le courtier pour les contrats à terme standardisés ouverts est Goldman Sachs.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

| Analyse du total des actifs (non auditée)                               | % du total des actifs |
|---|-----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs | 98,75                 |
| Instruments financiers dérivés négociés en Bourse                       | 0,01                  |
| Instruments financiers dérivés négociés de gré à gré                    | 0,04                  |
| Autres actifs   | 1,20                  |
| <b>Total des actifs</b>   | <b>100,00</b>         |

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|--|-------|----------------------|----------------------|
| <b>Actifs circulants</b>   |       |                      |                      |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                         |       |                      |                      |
|  | 1(e)  |                      |                      |
| Valeurs mobilières   |       | 2 228 878 414        | 1 435 234 375        |
| Instruments financiers dérivés   |       | 336 710              | 405 538              |
|  |       | <b>2 229 215 124</b> | <b>1 435 639 913</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie  | 1(f)  | 7 934 145            | 6 769 773            |
| Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties à des instruments financiers ouverts | 1(g)  | 482 240              | 114 514              |
| Créances :   |       |                      |                      |
| Dividendes à recevoir  |       | 4 152 873            | 2 554 159            |
| <b>Total des actifs circulants</b>   |       | <b>2 241 784 382</b> | <b>1 445 078 359</b> |
| <b>Passifs circulants</b>  |       |                      |                      |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                        |       |                      |                      |
|  | 1(e)  |                      |                      |
| Instruments financiers dérivés   |       | (333)                | -                    |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :   |       |                      |                      |
| Charges à payer  |       | (213 581)            | (140 233)            |
| À payer sur achats d'investissements   |       | (1 199)              | (690)                |
| <b>Total des passifs circulants</b>  |       | <b>(215 113)</b>     | <b>(140 923)</b>     |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>              |       | <b>2 241 569 269</b> | <b>1 444 937 436</b> |
|  |       | <b>2023</b>          | <b>2022</b>          |
|  |       | <b>2021</b>          |                      |
| Valeur liquidative par action  | 5     | 28,72 USD            | 30,82 USD            |
|  |       |                      | 27,94 USD            |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD         | 2022<br>USD       |
|--|-------|---------------------|-------------------|
| Produits de dividendes   |       | 37 856 835          | 20 970 311        |
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur   |       | 10 385              | 84                |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat                 | 9     | (70 990 979)        | 62 085 178        |
| Produits divers  |       | 74 343              | -                 |
| <b>Total des (charges)/revenus d'investissement</b>  |       | <b>(33 049 416)</b> | <b>83 055 573</b> |
| Charges opérationnelles  | 3     | (2 063 589)         | (1 388 227)       |
| <b>(Perte)/Bénéfice net(te) pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(35 113 005)</b> | <b>81 667 346</b> |
| <b>Charges financières</b>   |       |                     |                   |
| Charges d'intérêts   |       | -                   | (16 595)          |
| <b>(Perte)/Bénéfice pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(35 113 005)</b> | <b>81 650 751</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement  | 2     | (4 902 963)         | (2 665 046)       |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(40 015 968)</b> | <b>78 985 705</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|--|----------------------|----------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier                              | 1 444 937 436        | 743 807 270          |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(40 015 968)</b>  | <b>78 985 705</b>    |
| <b>Opérations sur actions</b>  |                      |                      |
| Produits sur actions de participation rachetables émises   | 893 257 749          | 644 951 174          |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables   | (56 609 948)         | (22 806 713)         |
| Augmentation des actifs nets résultant d'opérations sur actions  | 836 647 801          | 622 144 461          |
| <b>Augmentation totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                                | <b>796 631 833</b>   | <b>701 130 166</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>                       | <b>2 241 569 269</b> | <b>1 444 937 436</b> |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|--|-------|----------------------|----------------------|
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(40 015 968)</b>  | <b>78 985 705</b>    |
| <b>Ajustement pour :</b>   |       |                      |                      |
| Variation de la trésorerie détenue par/à payer au courtier   |       | (367 726)            | 520 087              |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat   |       | (793 643 530)        | (699 601 423)        |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés  |       | 69 161               | (307 480)            |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>  |       | <b>(833 958 063)</b> | <b>(620 403 111)</b> |
| Variation des montants à recevoir  |       | (1 598 714)          | (1 385 608)          |
| Variation des montants à payer   |       | 73 348               | 66 487               |
| <b>Sorties de trésorerie sur opérations</b>  |       | <b>(1 525 366)</b>   | <b>(1 319 121)</b>   |
| <b>Sorties de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>   |       | <b>(835 483 429)</b> | <b>(621 722 232)</b> |
| <b>Activités de financement</b>  |       |                      |                      |
| Produits des souscriptions   | 5     | 893 257 749          | 644 951 174          |
| Paiements sur rachats  | 5     | (56 609 948)         | (22 806 713)         |
| <b>Trésorerie nette générée sur activités de financement</b>   |       | <b>836 647 801</b>   | <b>622 144 461</b>   |
| <b>Augmentation nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>  |       | <b>1 164 372</b>     | <b>422 229</b>       |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier   |       | 6 769 773            | 6 347 544            |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>  |       | <b>7 934 145</b>     | <b>6 769 773</b>     |
| <b>Informations supplémentaires</b>  |       |                      |                      |
| Impôts payés   |       | (4 902 963)          | (2 665 046)          |
| Intérêts reçus   |       | 10 385               | 84                   |
| Intérêts payés   |       | -                    | (16 595)             |
| Dividendes reçus   |       | 36 258 121           | 19 584 703           |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                              | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar australien – 1,98 %</b>                         |                  |                   |
| 3 123 Ampol Ltd   | 63 774           | 0,00              |
| 61 336 APA Group CVS NPV                                  | 415 728          | 0,02              |
| 27 237 Aristocrat Leisure Ltd                             | 678 602          | 0,03              |
| 9 618 ASX   | 418 837          | 0,02              |
| 26 990 Aurizon Holdings Ltd                               | 60 737           | 0,00              |
| 130 446 Australia & New Zealand Banking Group             | 2 003 308        | 0,09              |
| 210 326 BHP Group Ltd                                     | 6 653 096        | 0,30              |
| 12 212 BlueScope Steel Ltd                                | 164 807          | 0,01              |
| 73 663 Brambles Ltd                                       | 662 580          | 0,03              |
| 3 271 Cochlear  | 518 529          | 0,02              |
| 60 447 Coles Group Ltd                                    | 729 529          | 0,03              |
| 72 645 Commonwealth Bank of Australia                     | 4 783 662        | 0,21              |
| 28 443 Computershare Ltd                                  | 411 283          | 0,02              |
| 19 523 CSL Ltd  | 3 769 676        | 0,17              |
| 41 054 Endeavour Group Ltd/Australia                      | 186 147          | 0,01              |
| 70 997 Fortescue Metals Group Ltd                         | 1 069 405        | 0,05              |
| 16 657 IDP Education Ltd                                  | 304 671          | 0,01              |
| 11 415 IGO Ltd  | 97 629           | 0,00              |
| 131 168 Insurance Australia Group Ltd                     | 412 016          | 0,02              |
| 18 614 LendLease Group CVS NPV                            | 90 134           | 0,00              |
| 82 465 Lottery Corp Ltd                                   | 282 782          | 0,01              |
| 15 427 Macquarie Group Ltd                                | 1 814 961        | 0,08              |
| 46 884 Medibank Pvt Ltd                                   | 105 506          | 0,00              |
| 5 192 Mineral Resources Ltd                               | 280 239          | 0,01              |
| 133 063 National Australia Bank                           | 2 470 378        | 0,11              |
| 37 273 Newcrest Mining Ltd                                | 670 273          | 0,03              |
| 41 632 Northern Star Resources Ltd                        | 343 240          | 0,02              |
| 11 911 Orica Ltd  | 122 772          | 0,01              |
| 83 962 Origin Energy Ltd                                  | 466 176          | 0,02              |
| 87 475 Pilbara Minerals Ltd                               | 230 830          | 0,01              |
| 7 018 Qantas Airways Ltd                                  | 31 116           | 0,00              |
| 71 456 QBE Insurance Group                                | 698 243          | 0,03              |
| 9 477 Ramsay Health Care Ltd                              | 422 344          | 0,02              |
| 641 REA Group Ltd   | 59 258           | 0,00              |
| 16 552 Rio Tinto Ltd                                      | 1 331 837        | 0,06              |
| 118 896 Santos Ltd  | 549 451          | 0,02              |
| 8 581 SEEK Ltd  | 137 471          | 0,01              |
| 21 566 Sonic Healthcare Ltd                               | 503 223          | 0,02              |
| 249 854 South32 Ltd                                       | 731 275          | 0,03              |
| 65 818 Suncorp Group                                      | 533 828          | 0,02              |
| 201 296 Telstra Group Ltd                                 | 568 932          | 0,03              |
| 131 690 Transurban Group CVS NPV                          | 1 253 314        | 0,06              |
| 12 917 Treasury Wine Estates Ltd                          | 113 071          | 0,01              |
| 801 Washington H Soul Pattinson & Co Ltd                  | 16 201           | 0,00              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %)</b>         |                   |                   |
| <b>(suite)</b>  |                   |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Dollar australien – 1,98 % (suite)</b>                         |                   |                   |
| 48 377 Wesfarmers   | 1 628 125         | 0,07              |
| 149 561 Westpac Banking Corp                                      | 2 169 650         | 0,10              |
| 5 912 WiseTech Global Ltd   | 257 926           | 0,01              |
| 79 494 Woodside Energy Group Ltd                                  | 1 775 059         | 0,08              |
| 40 536 Woolworths Group Ltd                                       | 1 028 947         | 0,05              |
| 5 887 Xero Ltd  | 352 567           | 0,02              |
|   | <b>44 443 145</b> | <b>1,98</b>       |
| <b>Dollar canadien – 3,30 %</b>                                   |                   |                   |
| 20 782 Agnico Eagle Mines   | 1 058 026         | 0,05              |
| 1 895 Air Canada  | 26 814            | 0,00              |
| 32 042 Algonquin Power & Utilities Corp                           | 268 487           | 0,01              |
| 37 385 Alimentation Couche-Tard Inc                               | 1 877 054         | 0,08              |
| 2 315 AltaGas Ltd   | 38 539            | 0,00              |
| 23 000 ARC Resources Ltd  | 260 531           | 0,01              |
| 26 327 Bank of Montreal   | 2 341 777         | 0,11              |
| 50 398 Bank of Nova Scotia  | 2 534 889         | 0,11              |
| 74 180 Barrick Gold Corp  | 1 375 236         | 0,06              |
| 2 694 BCE   | 120 512           | 0,01              |
| 12 514 Brookfield Asset Management Ltd                            | 409 351           | 0,02              |
| 54 658 Brookfield Corp  | 1 778 248         | 0,08              |
| 2 104 Brookfield Renewable Corp                                   | 73 473            | 0,00              |
| 15 202 CAE Inc  | 343 276           | 0,02              |
| 13 663 Cameco   | 357 286           | 0,02              |
| 36 910 Canadian Imperial Bank of Commerce                         | 1 563 019         | 0,07              |
| 26 313 Canadian National Railway Co                               | 3 100 554         | 0,14              |
| 50 103 Canadian Natural Resources Ltd                             | 2 768 835         | 0,12              |
| 39 607 Canadian Pacific Railway Ltd                               | 3 045 702         | 0,14              |
| 715 Canadian Tire Corp Ltd  | 93 180            | 0,00              |
| 4 495 Canadian Utilities Ltd                                      | 125 083           | 0,01              |
| 9 735 CCL Industries Inc  | 482 956           | 0,02              |
| 54 751 Cenovus Energy Inc   | 953 950           | 0,04              |
| 10 262 CGI Inc  | 987 642           | 0,04              |
| 826 Constellation Software Inc/Canada                             | 1 550 812         | 0,07              |
| 2 900 Descartes Systems Group Inc                                 | 233 740           | 0,01              |
| 9 877 Dollarama Inc   | 589 475           | 0,03              |
| 7 000 Element Fleet Management Corp                               | 91 809            | 0,00              |
| 13 445 Emera Inc  | 551 569           | 0,03              |
| 10 100 Empire Co Ltd  | 270 383           | 0,01              |
| 83 238 Enbridge Inc   | 3 169 361         | 0,14              |
| 1 234 Fairfax Financial Holdings Ltd                              | 819 564           | 0,04              |
| 29 507 First Quantum Minerals Ltd                                 | 677 417           | 0,03              |
| 1 500 FirstService Corp   | 211 065           | 0,01              |
| 23 132 Fortis Inc/Canada  | 981 958           | 0,04              |

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Dollar canadien – 3,30 % (suite)</b>                           |                  |                   | <b>Dollar canadien – 3,30 % (suite)</b>                           |                   |                   |
| 8 161 Franco-Nevada Corp  | 1 188 738        | 0,05              | 7 976 Thomson Reuters Corp  | 1 036 317         | 0,05              |
| 4 560 George Weston Ltd   | 603 463          | 0,03              | 700 TMX Group Ltd   | 70 603            | 0,00              |
| 6 400 GFL Environmental Inc                                       | 220 372          | 0,01              | 1 000 Toromont Industries Ltd                                     | 81 967            | 0,00              |
| 2 313 Gildan Activewear Inc                                       | 76 738           | 0,00              | 74 159 Toronto-Dominion Bank                                      | 4 435 786         | 0,20              |
| 13 777 Great-West Lifeco Inc                                      | 364 645          | 0,02              | 11 877 Tourmaline Oil Corp  | 494 264           | 0,02              |
| 19 133 Hydro One Ltd  | 544 011          | 0,03              | 1 199 West Fraser Timber Co Ltd                                   | 85 406            | 0,00              |
| 1 308 iA Financial Corp Inc                                       | 82 790           | 0,00              | 20 496 Wheaton Precious Metals Corp                               | 985 765           | 0,04              |
| 575 IGM Financial Inc   | 17 161           | 0,00              | 5 412 WSP Global Inc  | 707 937           | 0,03              |
| 12 340 Imperial Oil Ltd   | 626 688          | 0,03              |   | <b>73 997 418</b> | <b>3,30</b>       |
| 6 051 Intact Financial Corp                                       | 864 805          | 0,04              | <b>Couronne danoise – 0,88 %</b>                                  |                   |                   |
| 22 300 Ivanhoe Mines Ltd  | 201 192          | 0,01              | 29 AP Moller - Maersk A/S (Class A)                               | 51 431            | 0,00              |
| 9 611 Keyera Corp   | 210 137          | 0,01              | 319 AP Moller - Maersk A/S (Class B)                              | 579 002           | 0,03              |
| 32 501 Kinross Gold Corp  | 152 737          | 0,01              | 5 561 Carlsberg AS  | 862 145           | 0,04              |
| 5 500 Loblaw Cos Ltd  | 500 562          | 0,02              | 5 010 Chr Hansen Holding A/S                                      | 380 689           | 0,02              |
| 7 961 Lundin Mining Corp  | 54 001           | 0,00              | 5 111 Coloplast A/S   | 672 218           | 0,03              |
| 12 205 Magna International Inc                                    | 652 839          | 0,03              | 20 989 Danske Bank A/S  | 422 440           | 0,02              |
| 83 404 Manulife Financial Corp                                    | 1 528 370        | 0,07              | 2 092 Demant A/S  | 73 287            | 0,00              |
| 8 057 Metro Inc/CN  | 442 574          | 0,02              | 8 655 DSV A/S   | 1 674 436         | 0,07              |
| 14 011 National Bank of Canada                                    | 1 000 808        | 0,05              | 2 920 Genmab A/S  | 1 102 578         | 0,05              |
| 17 257 Northland Power Inc  | 432 015          | 0,02              | 68 151 Novo Nordisk A/S   | 10 792 360        | 0,48              |
| 23 509 Nutrien Ltd  | 1 733 796        | 0,08              | 9 397 Novozymes A/S   | 480 913           | 0,02              |
| 3 400 Nuvei Corp  | 147 923          | 0,01              | 9 371 Orsted AS   | 797 346           | 0,04              |
| 1 747 Onex Corp   | 81 557           | 0,00              | 5 037 Pandora A/S   | 481 474           | 0,02              |
| 12 692 Open Text Corp   | 488 886          | 0,02              | 91 Rockwool International   | 22 304            | 0,00              |
| 3 546 Pan American Silver   | 64 613           | 0,00              | 7 818 Tryg A/S  | 170 920           | 0,01              |
| 1 103 Parkland Corp   | 26 406           | 0,00              | 42 878 Vestas Wind Systems A/S                                    | 1 244 463         | 0,05              |
| 24 079 Pembina Pipeline Corp                                      | 778 940          | 0,04              |   | <b>19 808 006</b> | <b>0,88</b>       |
| 26 546 Power Corp of Canada                                       | 677 503          | 0,03              | <b>Euro – 9,47 %</b>  |                   |                   |
| 1 205 Quebecor Inc  | 29 748           | 0,00              | 1 500 Acciona SA  | 301 001           | 0,01              |
| 11 252 Restaurant Brands International Inc                        | 754 346          | 0,03              | 2 247 Accor SA  | 73 164            | 0,00              |
| 4 000 Ritchie Bros Auctioneers Inc                                | 224 746          | 0,01              | 16 691 ACS Actividades de Construccion y Servicios SA             | 532 231           | 0,02              |
| 15 728 Rogers Communications                                      | 727 973          | 0,03              | 8 012 adidas AG   | 1 416 941         | 0,06              |
| 57 037 Royal Bank of Canada                                       | 5 447 247        | 0,24              | 809 Adyen NV  | 1 282 546         | 0,06              |
| 17 888 Saputo Inc   | 462 219          | 0,02              | 93 831 Aegon NV   | 402 776           | 0,02              |
| 22 521 Shaw Communications  | 672 959          | 0,03              | 3 328 Aena SME SA   | 538 379           | 0,02              |
| 49 831 Shopify Inc  | 2 385 967        | 0,11              | 248 Aeroports de Paris  | 35 472            | 0,00              |
| 24 731 Sun Life Financial   | 1 153 815        | 0,05              | 9 274 Ageas SA/NV   | 401 619           | 0,02              |
| 63 185 Suncor Energy Inc  | 1 959 022        | 0,09              | 21 164 Air Liquide SA   | 3 545 617         | 0,16              |
| 46 133 TC Energy Corp   | 1 792 006        | 0,08              | 24 256 Airbus   | 3 248 789         | 0,15              |
| 22 573 Teck Resources Ltd   | 823 126          | 0,04              | 8 261 Akzo Nobel NV   | 646 032           | 0,03              |
| 22 612 TELUS Corp   | 448 280          | 0,02              | 16 627 Allianz SE   | 3 844 105         | 0,17              |
| 1 219 TELUS Corp (Non Canadian)                                   | 24 167           | 0,00              | 12 759 Alstom SA  | 347 659           | 0,02              |
| 2 500 TFI International Inc                                       | 297 909          | 0,01              | 19 017 Amadeus IT Group SA  | 1 273 958         | 0,06              |

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 9,47 % (suite)</b>                                      |                  |                   | <b>Euro – 9,47 % (suite)</b>                                      |                  |                   |
| 2 925 Amplifon SpA  | 101 501          | 0,01              | 28 129 Dassault Systemes SE                                       | 1 157 488        | 0,05              |
| 727 Amundi SA   | 45 851           | 0,00              | 6 722 Davide Campari-Milano NV                                    | 82 160           | 0,00              |
| 33 720 Anheuser-Busch InBev SA/NV                                 | 2 246 830        | 0,10              | 7 026 Delivery Hero SE  | 239 460          | 0,01              |
| 20 359 ArcelorMittal SA   | 616 457          | 0,03              | 84 817 Deutsche Bank AG   | 862 150          | 0,04              |
| 12 Argenx SE (Australia listing)                                  | 4 442            | 0,00              | 7 832 Deutsche Boerse AG  | 1 526 954        | 0,07              |
| 2 168 Argenx SE (Belgium listing)                                 | 802 493          | 0,04              | 4 920 Deutsche Lufthansa AG                                       | 54 843           | 0,00              |
| 3 695 Arkema SA   | 364 510          | 0,02              | 41 823 Deutsche Post AG   | 1 957 949        | 0,09              |
| 27 056 Aroundtown SA  | 38 596           | 0,00              | 138 204 Deutsche Telekom AG                                       | 3 355 891        | 0,15              |
| 1 981 ASM International NV  | 800 425          | 0,04              | 411 DiaSorin SpA  | 43 340           | 0,00              |
| 16 571 ASML Holding NV  | 11 255 827       | 0,50              | 95 013 E.ON SE  | 1 187 109        | 0,05              |
| 47 365 Assicurazioni Generali SpA                                 | 945 829          | 0,04              | 12 214 Edenred  | 723 740          | 0,03              |
| 79 077 AXA SA   | 2 419 745        | 0,11              | 152 668 EDP - Energias de Portugal                                | 831 985          | 0,04              |
| 279 880 Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA                        | 1 998 081        | 0,09              | 18 561 EDP Renovaveis SA  | 425 292          | 0,02              |
| 736 855 Banco Santander SA  | 2 742 705        | 0,12              | 4 149 Eiffage SA  | 449 596          | 0,02              |
| 27 021 Bank of Ireland Group PLC                                  | 273 724          | 0,01              | 238 Elia Group SA/NV  | 31 443           | 0,00              |
| 37 540 BASF SE  | 1 972 379        | 0,09              | 7 845 Elisa Oyj   | 473 549          | 0,02              |
| 41 467 Bayer AG   | 2 645 443        | 0,12              | 3 517 Enagas SA   | 67 633           | 0,00              |
| 14 657 Bayerische Motoren Werke AG (Voting rights)                | 1 607 378        | 0,07              | 8 608 Endesa SA   | 187 043          | 0,01              |
| 1 719 Bechtle AG  | 82 156           | 0,00              | 342 265 Enel SpA  | 2 092 421        | 0,09              |
| 6 060 Beiersdorf AG   | 789 737          | 0,04              | 78 142 Engie SA   | 1 237 294        | 0,06              |
| 1 526 BioMerieux  | 160 819          | 0,01              | 110 444 Eni SpA   | 1 548 615        | 0,07              |
| 46 477 BNP Paribas SA   | 2 787 825        | 0,12              | 14 669 Erste Group Bank AG  | 486 083          | 0,02              |
| 5 758 Bolloré SE  | 35 595           | 0,00              | 11 974 EssilorLuxottica SA  | 2 159 519        | 0,10              |
| 11 377 Bouygues SA  | 384 289          | 0,02              | 341 Eurazeo SE  | 24 266           | 0,00              |
| 6 778 Brenntag SE   | 509 586          | 0,02              | 6 095 Eurofins Scientific SE                                      | 408 175          | 0,02              |
| 15 350 Bureau Veritas SA  | 441 440          | 0,02              | 3 202 Euronext NV   | 245 535          | 0,01              |
| 183 820 CaixaBank SA  | 715 765          | 0,03              | 3 185 Evonik Industries AG  | 66 992           | 0,00              |
| 6 831 Capgemini SE  | 1 267 228        | 0,06              | 4 307 EXOR NV   | 354 881          | 0,02              |
| 833 Carl Zeiss Meditec AG   | 115 842          | 0,01              | 5 189 Ferrari NV  | 1 405 451        | 0,06              |
| 35 008 Carrefour SA   | 708 582          | 0,03              | 14 853 Ferrovial SA   | 437 152          | 0,02              |
| 19 045 Cellnex Telecom SA   | 739 926          | 0,03              | 27 246 FinecoBank Banca Fineco SpA                                | 418 564          | 0,02              |
| 20 661 Cie de Saint-Gobain  | 1 174 434        | 0,05              | 7 810 Flutter Entertainment PLC                                   | 1 422 539        | 0,06              |
| 28 780 Cie Generale des Etablissements Michelin SCA               | 880 039          | 0,04              | 21 237 Fortum Oyj   | 325 675          | 0,02              |
| 48 171 CNH Industrial NV  | 736 882          | 0,03              | 8 987 Fresenius Medical Care AG & Co KGaA                         | 381 770          | 0,02              |
| 41 626 Commerzbank AG   | 438 769          | 0,02              | 17 987 Fresenius SE & Co KGaA                                     | 485 618          | 0,02              |
| 5 057 Continental AG  | 378 659          | 0,02              | 7 136 Galp Energia SGPS SA  | 81 095           | 0,00              |
| 9 104 Covestro AG   | 377 145          | 0,02              | 1 853 GEA Group AG  | 84 453           | 0,00              |
| 52 105 Credit Agricole SA   | 588 625          | 0,03              | 23 603 Getlink SE   | 389 524          | 0,02              |
| 31 635 CRH PLC  | 1 597 338        | 0,07              | 7 921 Grifols SA  | 78 381           | 0,00              |
| 17 898 Daimler Truck Holding AG                                   | 604 943          | 0,03              | 6 428 Groupe Bruxelles Lambert NV                                 | 548 220          | 0,03              |
| 26 744 Danone SA  | 1 665 200        | 0,07              | 2 760 Hannover Rueck SE   | 540 798          | 0,02              |
| 1 800 Dassault Aviation SA  | 357 094          | 0,02              | 7 591 HeidelbergCement AG   | 554 709          | 0,03              |
|   |                  |                   | 7 230 Heineken Holding NV   | 664 143          | 0,03              |



## SPDR MSCI World UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Euro – 9,47 % (suite)</b>                                      |                  |                   | <b>Euro – 9,47 % (suite)</b>                                      |                  |                   |
| 11 052 Heineken NV  | 1 189 457        | 0,05              | 11 322 NN Group NV  | 411 584          | 0,02              |
| 10 846 HelloFresh SE  | 258 179          | 0,01              | 234 996 Nokia Oyj   | 1 152 859        | 0,05              |
| 6 248 Henkel AG & Co KGaA (Voting rights)                         | 454 805          | 0,02              | 9 320 OMV AG  | 427 913          | 0,02              |
| 1 244 Hermes International  | 2 519 277        | 0,11              | 87 165 Orange SA  | 1 037 159        | 0,05              |
| 268 760 Iberdrola SA  | 3 353 554        | 0,15              | 1 572 Orion Oyj   | 70 348           | 0,00              |
| 1 959 IMCD NV   | 320 105          | 0,01              | 8 110 Pemod Ricard SA   | 1 838 878        | 0,08              |
| 46 531 Industria de Diseno Textil SA                              | 1 562 106        | 0,07              | 6 180 Poste Italiane SpA  | 63 195           | 0,00              |
| 55 279 Infineon Technologies                                      | 2 262 980        | 0,10              | 34 902 Prosus NV  | 2 727 913        | 0,12              |
| 3 962 Infrastrutture Wireless Italiane SpA                        | 52 171           | 0,00              | 11 792 Prysmian SpA   | 495 802          | 0,02              |
| 159 609 ING Groep NV  | 1 895 341        | 0,09              | 11 021 Publicis Groupe SA   | 859 477          | 0,04              |
| 675 462 Intesa Sanpaolo SpA                                       | 1 737 403        | 0,08              | 4 833 Puma SE   | 298 561          | 0,01              |
| 291 Ipsen SA  | 32 090           | 0,00              | 10 631 QIAGEN NV  | 484 063          | 0,02              |
| 943 JDE Peet's NV   | 27 478           | 0,00              | 4 776 Randstad NV   | 283 313          | 0,01              |
| 1 827 Jeronimo Martins SGPS SA                                    | 42 915           | 0,00              | 61 Rational AG  | 40 891           | 0,00              |
| 7 626 Just Eat Takeaway.com NV                                    | 145 241          | 0,01              | 1 720 Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA              | 72 804           | 0,00              |
| 10 787 KBC Group NV   | 741 847          | 0,03              | 22 092 Red Electrica Corp SA                                      | 388 830          | 0,02              |
| 3 167 Kering SA   | 2 064 472        | 0,09              | 157 Remy Cointreau  | 28 656           | 0,00              |
| 6 683 Kerry Group PLC   | 666 827          | 0,03              | 4 367 Renault SA  | 178 394          | 0,01              |
| 17 057 Kesko Oyj  | 367 018          | 0,02              | 68 307 Repsol SA  | 1 052 699        | 0,05              |
| 6 424 Kingspan Group  | 439 979          | 0,02              | 1 307 Rheinmetall AG  | 388 509          | 0,02              |
| 3 389 Knorr-Bremse AG   | 225 632          | 0,01              | 27 549 RWE AG   | 1 186 449        | 0,05              |
| 14 550 Kone Oyj   | 758 777          | 0,03              | 14 103 Safran SA  | 2 092 094        | 0,09              |
| 45 415 Koninklijke Ahold Delhaize NV                              | 1 553 752        | 0,07              | 20 255 Sampo Oyj  | 956 823          | 0,04              |
| 7 282 Koninklijke DSM NV  | 859 983          | 0,04              | 46 891 Sanofi   | 5 106 699        | 0,23              |
| 165 287 Koninklijke KPN NV  | 584 700          | 0,03              | 42 500 SAP SE   | 5 358 969        | 0,24              |
| 39 866 Koninklijke Philips NV                                     | 729 208          | 0,03              | 1 390 Sartorius Stedim Biotech                                    | 425 867          | 0,02              |
| 574 La Francaise des Jeux SAEM                                    | 23 941           | 0,00              | 23 669 Schneider Electric SE (France listing)                     | 3 951 909        | 0,18              |
| 3 638 LEG Immobilien SE   | 199 522          | 0,01              | 2 922 Scout24 SE  | 173 651          | 0,01              |
| 11 472 Legrand SA   | 1 047 952        | 0,05              | 181 SEB SA  | 20 609           | 0,00              |
| 10 190 L'Oreal SA   | 4 552 918        | 0,20              | 31 356 Siemens AG   | 5 084 799        | 0,23              |
| 11 340 LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE                        | 10 403 297       | 0,46              | 14 753 Siemens Energy AG  | 324 415          | 0,02              |
| 13 384 Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA                | 134 766          | 0,01              | 11 537 Siemens Healthineers AG                                    | 664 572          | 0,03              |
| 35 696 Mercedes-Benz Group AG                                     | 2 744 984        | 0,12              | 13 734 Smurfit Kappa Group PLC                                    | 497 327          | 0,02              |
| 5 544 Merck KGaA  | 1 033 293        | 0,05              | 86 765 Snam SpA   | 460 866          | 0,02              |
| 25 000 Metso Outotec Oyj  | 272 699          | 0,01              | 34 035 Societe Generale SA  | 768 574          | 0,03              |
| 10 286 Moncler SpA  | 710 074          | 0,03              | 4 863 Sodexo SA   | 475 824          | 0,02              |
| 2 543 MTU Aero Engines AG   | 637 111          | 0,03              | 199 Sofina SA   | 44 624           | 0,00              |
| 5 928 Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen   | 2 077 053        | 0,09              | 4 216 Solvay SA   | 482 553          | 0,02              |
| 2 729 Naturgy Energy Group SA                                     | 82 277           | 0,00              | 101 424 Stellantis NV   | 1 844 175        | 0,08              |
| 1 258 Nemetschek SE   | 86 488           | 0,00              | 27 747 STMicroelectronics NV                                      | 1 475 784        | 0,07              |
| 18 344 Nestle Oyj   | 905 413          | 0,04              | 29 030 Stora Enso Oyj   | 377 845          | 0,02              |
| 33 015 Nexi SpA   | 268 516          | 0,01              | 5 837 Symrise AG  | 635 429          | 0,03              |
|   |                  |                   | 365 537 Telecom Italia SpA/Milano                                 | 120 809          | 0,01              |

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD   | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|--------------------|-------------------|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                    |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                    |                   | <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Euro – 9,47 % (suite)</b>                                      |                    |                   | <b>Dollar de Hong Kong – 0,71 % (suite)</b>                       |                   |                   |
| 7 397 Telefonica Deutschland Holding AG                           | 22 799             | 0,00              | 103 400 MTR Corp Ltd  | 498 562           | 0,02              |
| 208 018 Telefonica SA   | 897 903            | 0,04              | 40 310 New World Development Co Ltd                               | 108 093           | 0,01              |
| 2 447 Teleperformance   | 589 399            | 0,03              | 109 000 Power Assets Holdings Ltd                                 | 584 577           | 0,03              |
| 17 653 Tenaris SA   | 251 246            | 0,01              | 140 000 Sands China Ltd   | 486 882           | 0,02              |
| 73 906 Terna - Rete Elettrica Nazionale                           | 607 513            | 0,03              | 128 289 Sino Land Co Ltd  | 173 559           | 0,01              |
| 5 434 Thales SA   | 804 979            | 0,04              | 52 000 SITC International Holdings Co Ltd                         | 111 685           | 0,01              |
| 103 711 TotalEnergies SE  | 6 125 111          | 0,27              | 54 500 Sun Hung Kai Properties Ltd                                | 763 699           | 0,03              |
| 5 838 UCB SA  | 522 892            | 0,02              | 3 500 Swire Pacific Ltd   | 26 886            | 0,00              |
| 9 279 Umicore SA  | 314 633            | 0,01              | 8 200 Swire Properties Ltd  | 21 101            | 0,00              |
| 89 403 UniCredit SpA  | 1 691 066          | 0,08              | 50 000 Techtronic Industries Co Ltd                               | 540 449           | 0,02              |
| 766 United Internet AG  | 13 207             | 0,00              | 154 515 WH Group Ltd  | 92 119            | 0,00              |
| 30 284 Universal Music Group NV                                   | 766 782            | 0,03              | 61 000 Wharf Real Estate Investment Co Ltd                        | 350 461           | 0,02              |
| 22 943 UPM-Kymmene Oyj  | 771 473            | 0,04              | 22 000 Xinyi Glass Holdings Ltd                                   | 39 404            | 0,00              |
| 6 153 Valeo   | 126 412            | 0,01              |   | <b>15 895 658</b> | <b>0,71</b>       |
| 31 934 Veolia Environnement SA                                    | 985 329            | 0,04              | <b>Nouveau shekel israélien – 0,12 %</b>                          |                   |                   |
| 2 534 Verbund AG  | 220 245            | 0,01              | 327 Azrieli Group Ltd   | 18 690            | 0,00              |
| 23 914 Vinci SA   | 2 746 750          | 0,12              | 63 493 Bank Hapoalim BM   | 524 605           | 0,02              |
| 39 108 Vivendi SE   | 395 147            | 0,02              | 76 939 Bank Leumi Le-Israel BM                                    | 576 938           | 0,03              |
| 766 voestalpine AG  | 26 032             | 0,00              | 1 707 Elbit Systems Ltd   | 288 715           | 0,01              |
| 1 527 Volkswagen AG (Voting rights)                               | 262 123            | 0,01              | 36 335 ICL Group Ltd  | 243 502           | 0,01              |
| 29 436 Vonovia SE   | 554 546            | 0,03              | 1 Isracard Ltd  | 2                 | 0,00              |
| 3 456 Wartsila OYJ Abp  | 32 621             | 0,00              | 25 844 Israel Discount Bank Ltd                                   | 125 967           | 0,01              |
| 214 Wendel SE   | 22 634             | 0,00              | 1 075 Mizrahi Tefahot Bank Ltd                                    | 33 498            | 0,00              |
| 10 949 Wolters Kluwer NV  | 1 384 046          | 0,06              | 3 152 Nice Ltd  | 704 870           | 0,03              |
| 9 196 Worldline SA/France   | 390 748            | 0,02              | 6 000 Tower Semiconductor Ltd                                     | 254 954           | 0,01              |
| 8 764 Zalando SE  | 366 964            | 0,02              |   | <b>2 771 741</b>  | <b>0,12</b>       |
|   | <b>212 160 636</b> | <b>9,47</b>       | <b>Yen japonais – 6,09 %</b>                                      |                   |                   |
| <b>Dollar de Hong Kong – 0,71 %</b>                               |                    |                   | 9 000 Advantest Corp  | 822 301           | 0,04              |
| 492 600 AIA Group Ltd   | 5 186 452          | 0,23              | 35 500 Aeon Co Ltd  | 684 447           | 0,03              |
| 180 000 BOC Hong Kong Holdings Ltd                                | 560 641            | 0,03              | 8 900 AGC Inc   | 329 345           | 0,01              |
| 58 800 Budweiser Brewing Co APAC Ltd                              | 179 397            | 0,01              | 4 200 Aisin Corp  | 115 027           | 0,01              |
| 62 289 CK Asset Holdings Ltd                                      | 378 101            | 0,02              | 25 500 Ajinomoto Co Inc   | 882 508           | 0,04              |
| 148 000 CK Hutchison Holdings Ltd                                 | 918 171            | 0,04              | 1 400 ANA Holdings Inc  | 30 253            | 0,00              |
| 9 000 CK Infrastructure Holdings Ltd                              | 48 956             | 0,00              | 25 400 Asahi Group Holdings Ltd                                   | 939 737           | 0,04              |
| 108 000 CLP Holdings Ltd  | 780 081            | 0,03              | 4 500 Asahi Intecc Co Ltd   | 78 578            | 0,00              |
| 20 200 ESR Group Ltd  | 36 232             | 0,00              | 67 700 Asahi Kasei Corp   | 471 189           | 0,02              |
| 91 000 Galaxy Entertainment Group Ltd                             | 608 023            | 0,03              | 81 000 Astellas Pharma  | 1 146 014         | 0,05              |
| 26 000 Hang Lung Properties Ltd                                   | 48 622             | 0,00              | 1 500 Azbil   | 40 687            | 0,00              |
| 34 000 Hang Seng Bank Ltd   | 483 799            | 0,02              | 27 000 Bandai Namco Holdings Inc                                  | 577 876           | 0,03              |
| 107 000 Henderson Land Development Co Ltd                         | 370 072            | 0,02              | 29 600 Bridgestone Corp   | 1 193 652         | 0,05              |
| 52 000 HKT Trust & HKT Com HDK 0.0005                             | 69 025             | 0,00              | 2 800 Brother Industries Ltd                                      | 41 908            | 0,00              |
| 430 415 Hong Kong & China Gas Co Ltd                              | 378 877            | 0,02              | 41 300 Canon Inc  | 917 140           | 0,04              |
| 46 255 Hong Kong Exchanges & Clearing                             | 2 051 732          | 0,09              | 2 000 Capcom Co Ltd   | 71 155            | 0,00              |

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Yen japonais – 6,09 % (suite)</b>                              |                  |                   | <b>Yen japonais – 6,09 % (suite)</b>                              |                  |                   |
| 3 800 Central Japan Railway Co                                    | 451 409          | 0,02              | 500 Itochu Techno-Solutions                                       | 12 229           | 0,00              |
| 3 900 Chiba Bank Ltd  | 25 054           | 0,00              | 2 200 Japan Airlines Co Ltd                                       | 42 681           | 0,00              |
| 36 000 Chubu Electric Power Co Inc                                | 378 421          | 0,02              | 29 200 Japan Exchange Group Inc                                   | 442 860          | 0,02              |
| 35 500 Chugai Pharmaceutical Co Ltd                               | 872 229          | 0,04              | 59 900 Japan Post Bank Co Ltd                                     | 487 427          | 0,02              |
| 1 200 Concordia Financial Group Ltd                               | 4 400            | 0,00              | 102 400 Japan Post Holdings Co Ltd                                | 828 264          | 0,04              |
| 9 500 CyberAgent Inc  | 79 589           | 0,00              | 1 400 Japan Post Insurance Co Ltd                                 | 21 743           | 0,00              |
| 4 400 Dai Nippon Printing Co Ltd                                  | 122 489          | 0,01              | 60 000 Japan Tobacco Inc  | 1 261 402        | 0,06              |
| 3 600 Daifuku Co Ltd  | 66 082           | 0,00              | 30 400 JFE Holdings Inc   | 383 512          | 0,02              |
| 42 200 Dai-ichi Life Holdings Inc                                 | 772 087          | 0,03              | 3 400 JSR Corp  | 79 578           | 0,00              |
| 76 800 Daiichi Sankyo Co Ltd                                      | 2 782 550        | 0,12              | 13 500 Kajima Corp  | 162 093          | 0,01              |
| 10 100 Daikin Industries Ltd                                      | 1 795 142        | 0,08              | 38 700 Kansai Electric Power Co Inc                               | 375 398          | 0,02              |
| 800 Daito Trust Construction Co Ltd                               | 79 285           | 0,00              | 26 300 Kao Corp   | 1 021 054        | 0,05              |
| 29 800 Daiwa House Industry Co Ltd                                | 697 251          | 0,03              | 71 300 KDDI Corp  | 2 192 733        | 0,10              |
| 74 600 Daiwa Securities Group Inc                                 | 348 085          | 0,02              | 1 300 Keio Corp   | 45 372           | 0,00              |
| 22 200 Denso Corp   | 1 241 525        | 0,06              | 3 900 Keisei Electric Railway                                     | 119 412          | 0,01              |
| 9 000 Dentsu Group Inc  | 314 449          | 0,01              | 7 700 Keyence   | 3 728 793        | 0,17              |
| 1 800 Disco Corp  | 206 928          | 0,01              | 3 500 Kikkoman Corp   | 177 248          | 0,01              |
| 18 200 East Japan Railway Co                                      | 1 003 058        | 0,05              | 4 200 Kintetsu Group Holdings Co Ltd                              | 134 593          | 0,01              |
| 9 200 Eisai Co Ltd  | 518 723          | 0,02              | 46 400 Kirin Holdings Co Ltd                                      | 730 742          | 0,03              |
| 181 800 ENEOS Holdings Inc  | 635 460          | 0,03              | 600 Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd                               | 36 472           | 0,00              |
| 38 000 FANUC Corp   | 1 359 080        | 0,06              | 800 Kobe Bussan Co Ltd  | 22 150           | 0,00              |
| 7 000 Fast Retailing Co Ltd                                       | 1 518 972        | 0,07              | 1 560 Koei Tecmo Holdings Co Ltd                                  | 27 991           | 0,00              |
| 4 000 Fuji Electric Co Ltd  | 156 285          | 0,01              | 2 600 Koito Manufacturing   | 48 839           | 0,00              |
| 21 100 FUJIFILM Holdings Corp                                     | 1 061 896        | 0,05              | 39 800 Komatsu Ltd  | 979 973          | 0,04              |
| 6 100 Fujitsu Ltd   | 817 443          | 0,04              | 1 100 Konami Group Corp   | 50 169           | 0,00              |
| 1 600 GMO Payment Gateway Inc                                     | 136 810          | 0,01              | 400 Kose Corp   | 47 126           | 0,00              |
| 1 500 Hakuodo DY Holdings Inc                                     | 16 850           | 0,00              | 41 600 Kubota Corp  | 624 828          | 0,03              |
| 4 300 Hamamatsu Photonics KK                                      | 229 717          | 0,01              | 1 300 Kurita Water Industries                                     | 58 998           | 0,00              |
| 18 900 Hankyu Hanshin Holdings Inc                                | 557 386          | 0,03              | 18 600 Kyocera  | 962 633          | 0,04              |
| 300 Hikari Tsushin Inc  | 41 859           | 0,00              | 21 600 Kyowa Kirin Co Ltd   | 468 387          | 0,02              |
| 400 Hirose Electric Co Ltd  | 51 905           | 0,00              | 2 500 Lasertec Corp   | 437 298          | 0,02              |
| 600 Hitachi Construction Machinery Co Ltd                         | 13 863           | 0,00              | 25 300 Lixil Corp   | 413 841          | 0,02              |
| 40 700 Hitachi Ltd  | 2 217 720        | 0,10              | 25 100 M3 Inc   | 622 549          | 0,03              |
| 71 500 Honda Motor Co Ltd   | 1 885 679        | 0,08              | 21 000 Makita Corp  | 517 545          | 0,02              |
| 1 200 Hoshizaki Corp  | 44 045           | 0,00              | 79 300 Marubeni Corp  | 1 069 826        | 0,05              |
| 13 000 Hoya Corp  | 1 422 196        | 0,06              | 6 000 MatsukiyoCocokara & Co                                      | 316 027          | 0,01              |
| 3 200 Hulic Co Ltd  | 26 136           | 0,00              | 16 400 Mazda Motor Corp   | 150 950          | 0,01              |
| 1 300 Ibiden Co Ltd   | 51 379           | 0,00              | 400 McDonald's Holdings Co Japan Ltd                              | 16 590           | 0,00              |
| 4 274 Idemitsu Kosan Co Ltd                                       | 93 129           | 0,00              | 12 200 MEIJI Holdings Co Ltd                                      | 289 210          | 0,01              |
| 900 Iida Group Holdings Co Ltd                                    | 14 600           | 0,00              | 27 600 MINEBEA MITSUMI Inc  | 520 727          | 0,02              |
| 53 100 Inpex Corp   | 557 372          | 0,03              | 22 000 MISUMI Group Inc   | 545 496          | 0,02              |
| 30 600 Isuzu Motors Ltd   | 363 043          | 0,02              | 69 000 Mitsubishi Chemical Group Corp                             | 407 343          | 0,02              |
| 58 500 ITOCHU Corp  | 1 890 514        | 0,08              | 60 900 Mitsubishi Corp  | 2 173 987        | 0,10              |

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Yen japonais – 6,09 % (suite)</b>                              |                  |                   | <b>Yen japonais – 6,09 % (suite)</b>                              |                  |                   |
| 80 300 Mitsubishi Electric Corp                                   | 952 390          | 0,04              | 500 Oracle Corp Japan   | 35 803           | 0,00              |
| 64 900 Mitsubishi Estate Co Ltd                                   | 768 764          | 0,03              | 31 500 Oriental Land Co Ltd/Japan                                 | 1 071 696        | 0,05              |
| 3 100 Mitsubishi HC Capital Inc                                   | 15 932           | 0,00              | 37 300 ORIX   | 609 989          | 0,03              |
| 21 100 Mitsubishi Heavy Industries Ltd                            | 773 038          | 0,03              | 28 100 Osaka Gas Co Ltd   | 460 486          | 0,02              |
| 519 400 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc                        | 3 309 033        | 0,15              | 1 300 Otsuka Corp   | 45 762           | 0,00              |
| 68 200 Mitsui & Co Ltd  | 2 109 183        | 0,09              | 24 200 Otsuka Holdings Co Ltd                                     | 764 239          | 0,03              |
| 4 500 Mitsui Chemicals Inc  | 115 298          | 0,01              | 11 400 Pan Pacific International Holdings Corp                    | 219 195          | 0,01              |
| 40 300 Mitsui Fudosan   | 752 162          | 0,03              | 106 100 Panasonic Holdings Corp                                   | 942 296          | 0,04              |
| 5 000 Mitsui OSK Lines Ltd  | 124 352          | 0,01              | 5 800 Persol Holdings Co Ltd                                      | 115 660          | 0,01              |
| 110 860 Mizuho Financial Group Inc                                | 1 564 318        | 0,07              | 28 900 Rakuten  | 133 328          | 0,01              |
| 8 600 MonotaRO Co Ltd   | 107 072          | 0,01              | 65 100 Recruit Holdings Co Ltd                                    | 1 785 371        | 0,08              |
| 20 600 MS&AD Insurance Group Holdings Inc                         | 635 537          | 0,03              | 39 200 Renesas Electronics Corp                                   | 563 598          | 0,03              |
| 27 900 Murata Manufacturing Co Ltd                                | 1 685 446        | 0,08              | 115 100 Resona Holdings Inc                                       | 553 058          | 0,02              |
| 9 200 NEC   | 352 543          | 0,02              | 37 700 Ricoh Co Ltd   | 280 718          | 0,01              |
| 28 800 Nexon Co Ltd   | 682 726          | 0,03              | 1 000 Rohm Co Ltd   | 82 425           | 0,00              |
| 3 900 NGK Insulators  | 51 340           | 0,00              | 4 300 SBI Holdings Inc  | 84 779           | 0,00              |
| 23 700 Nidec Corp   | 1 218 923        | 0,05              | 900 SCSK Corp   | 13 085           | 0,00              |
| 22 500 Nihon M&A Center Holdings Inc                              | 166 354          | 0,01              | 7 200 Secom Co Ltd  | 441 662          | 0,02              |
| 42 700 Nintendo Co Ltd  | 1 646 207        | 0,07              | 12 000 Seiko Epson Corp   | 169 600          | 0,01              |
| 900 Nippon Express Holdings Inc                                   | 53 896           | 0,00              | 9 400 Sekisui Chemical  | 132 500          | 0,01              |
| 37 600 Nippon Paint Holdings Co Ltd                               | 349 754          | 0,02              | 35 400 Sekisui House Ltd  | 717 629          | 0,03              |
| 1 000 Nippon Sanso Holdings Corp                                  | 17 898           | 0,00              | 35 900 Seven & i Holdings Co Ltd                                  | 1 611 710        | 0,07              |
| 300 Nippon Shinyaku Co Ltd  | 13 141           | 0,00              | 3 700 SG Holdings Co Ltd  | 54 489           | 0,00              |
| 39 300 Nippon Steel Corp  | 921 301          | 0,04              | 1 400 Sharp Corp/Japan  | 9 814            | 0,00              |
| 51 200 Nippon Telegraph & Telephone Corp                          | 1 524 190        | 0,07              | 19 100 Shimadzu Corp  | 594 139          | 0,03              |
| 13 300 Nippon Yusen KK  | 308 691          | 0,01              | 1 700 Shimano Inc   | 291 742          | 0,01              |
| 1 400 Nissan Chemical Corp  | 63 010           | 0,00              | 13 300 Shimizu Corp   | 74 949           | 0,00              |
| 114 400 Nissan Motor Co Ltd                                       | 430 730          | 0,02              | 74 000 Shin-Etsu Chemical Co Ltd                                  | 2 376 963        | 0,11              |
| 1 400 Nisshin Seifun Group Inc                                    | 16 315           | 0,00              | 9 300 Shionogi & Co Ltd   | 417 658          | 0,02              |
| 1 000 Nissin Foods Holdings Co Ltd                                | 91 141           | 0,00              | 17 700 Shiseido   | 822 028          | 0,04              |
| 2 400 Nitori Holdings Co Ltd                                      | 287 264          | 0,01              | 2 700 Shizuoka Financial Group Inc                                | 19 293           | 0,00              |
| 6 000 Nitto Denko Corp  | 385 453          | 0,02              | 1 900 SMC Corp  | 996 897          | 0,04              |
| 149 000 Nomura Holdings Inc                                       | 570 631          | 0,03              | 118 400 SoftBank Corp   | 1 360 234        | 0,06              |
| 800 Nomura Real Estate Holdings Inc                               | 17 612           | 0,00              | 44 706 SoftBank Group   | 1 740 675        | 0,08              |
| 22 800 Nomura Research Institute Ltd                              | 525 073          | 0,02              | 8 800 Sampo Holdings Inc  | 347 266          | 0,02              |
| 35 200 NTT Data Corp  | 458 084          | 0,02              | 50 400 Sony   | 4 538 613        | 0,20              |
| 12 700 Obayashi Corp  | 96 665           | 0,00              | 1 100 Square Enix Holdings Co Ltd                                 | 52 566           | 0,00              |
| 2 300 Obic Co Ltd   | 361 184          | 0,02              | 35 100 Subaru Corp  | 557 660          | 0,03              |
| 9 200 Odakyu Electric Railway Co Ltd                              | 118 897          | 0,01              | 3 100 SUMCO Corp  | 46 142           | 0,00              |
| 23 000 Oji Holdings Corp  | 90 555           | 0,00              | 74 600 Sumitomo Chemical Co Ltd                                   | 249 433          | 0,01              |
| 52 500 Olympus  | 914 578          | 0,04              | 59 500 Sumitomo Corp  | 1 046 581        | 0,05              |
| 4 400 Omron   | 254 796          | 0,01              | 39 300 Sumitomo Electric Industries Ltd                           | 501 105          | 0,02              |
| 24 000 Ono Pharmaceutical   | 498 430          | 0,02              | 9 100 Sumitomo Metal Mining                                       | 345 224          | 0,02              |

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|---|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Yen japonais – 6,09 % (suite)</b>                              |                    |                   |
| 49 400 Sumitomo Mitsui Financial Group Inc                        | 1 966 498          | 0,09              |
| 15 500 Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc                         | 528 856            | 0,02              |
| 22 400 Sumitomo Realty & Development Co Ltd                       | 501 892            | 0,02              |
| 4 300 Suntory Beverage & Food Ltd                                 | 159 445            | 0,01              |
| 23 100 Suzuki Motor Corp  | 833 815            | 0,04              |
| 6 100 Sysmex Corp   | 396 140            | 0,02              |
| 33 900 T&D Holdings Inc   | 417 987            | 0,02              |
| 17 100 Taisei Corp  | 526 144            | 0,02              |
| 67 600 Takeda Pharmaceutical Co Ltd                               | 2 209 482          | 0,10              |
| 9 400 TDK   | 333 722            | 0,02              |
| 33 600 Terumo   | 902 295            | 0,04              |
| 2 900 TIS Inc   | 76 046             | 0,00              |
| 4 200 Tobu Railway Co Ltd   | 100 038            | 0,00              |
| 3 800 Toho Co Ltd/Tokyo   | 144 759            | 0,01              |
| 84 900 Tokio Marine Holdings Inc                                  | 1 624 767          | 0,07              |
| 32 200 Tokyo Electric Power Co Holdings Inc                       | 114 438            | 0,01              |
| 18 000 Tokyo Electron Ltd   | 2 169 359          | 0,10              |
| 27 800 Tokyo Gas Co Ltd   | 521 367            | 0,02              |
| 13 200 Tokyu Corp   | 174 757            | 0,01              |
| 4 400 TOPPAN INC  | 88 106             | 0,00              |
| 76 300 Toray Industries Inc                                       | 433 641            | 0,02              |
| 24 200 Toshiba Corp   | 808 243            | 0,04              |
| 8 500 Tosoh Corp  | 114 768            | 0,01              |
| 4 300 TOTO Ltd  | 142 806            | 0,01              |
| 3 600 Toyota Industries Corp                                      | 198 813            | 0,01              |
| 447 000 Toyota Motor  | 6 314 223          | 0,28              |
| 9 000 Toyota Tsusho Corp  | 380 044            | 0,02              |
| 3 500 Trend Micro Inc/Japan                                       | 170 148            | 0,01              |
| 24 300 Unicharm Corp  | 993 435            | 0,04              |
| 3 700 USS Co Ltd  | 63 803             | 0,00              |
| 600 Welcia Holdings Co Ltd  | 12 776             | 0,00              |
| 7 200 West Japan Railway Co                                       | 295 217            | 0,01              |
| 3 200 Yakult Honsha Co Ltd  | 231 543            | 0,01              |
| 1 600 Yamaha Corp   | 61 192             | 0,00              |
| 22 100 Yamaha Motor Co Ltd  | 574 544            | 0,03              |
| 9 200 Yamato Holdings Co Ltd                                      | 156 847            | 0,01              |
| 8 700 Yaskawa Electric  | 377 181            | 0,02              |
| 4 700 Yokogawa Electric   | 75 926             | 0,00              |
| 119 500 Z Holdings Corp   | 334 733            | 0,02              |
| 2 000 ZOZO Inc  | 45 308             | 0,00              |
|   | <b>136 573 072</b> | <b>6,09</b>       |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar néo-zélandais – 0,06 %</b>                              |                  |                   |
| 38 753 Auckland International Airport Ltd                         | 210 939          | 0,01              |
| 20 279 Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd                        | 338 123          | 0,01              |
| 33 544 Mercury NZ Ltd   | 132 427          | 0,01              |
| 55 180 Meridian Energy Ltd  | 181 248          | 0,01              |
| 141 738 Spark New Zealand Ltd                                     | 448 712          | 0,02              |
|   | <b>1 311 449</b> | <b>0,06</b>       |
| <b>Couronne norvégienne – 0,19 %</b>                              |                  |                   |
| 1 771 Adevinta ASA  | 12 556           | 0,00              |
| 8 296 Aker BP ASA   | 203 021          | 0,01              |
| 40 077 DNB Bank ASA   | 716 925          | 0,03              |
| 43 951 Equinor ASA  | 1 253 513        | 0,05              |
| 1 485 Gjensidige Forsikring ASA                                   | 24 289           | 0,00              |
| 25 824 Mowi ASA   | 476 875          | 0,02              |
| 58 402 Norsk Hydro ASA  | 433 842          | 0,02              |
| 59 160 Orkla ASA  | 419 477          | 0,02              |
| 34 212 Telenor ASA  | 400 818          | 0,02              |
| 9 402 Yara International ASA                                      | 407 479          | 0,02              |
|   | <b>4 348 795</b> | <b>0,19</b>       |
| <b>Livre sterling – 4,17 %</b>                                    |                  |                   |
| 41 189 3i Group PLC   | 858 139          | 0,04              |
| 120 190 abrdn PLC   | 302 419          | 0,01              |
| 4 258 Admiral Group PLC   | 107 297          | 0,00              |
| 51 239 Anglo American PLC   | 1 696 633        | 0,08              |
| 8 797 Antofagasta   | 171 966          | 0,01              |
| 18 353 Ashtead Group  | 1 125 098        | 0,05              |
| 21 677 Associated British Foods PLC                               | 519 969          | 0,02              |
| 65 339 AstraZeneca PLC  | 9 074 154        | 0,40              |
| 58 134 Auto Trader Group PLC                                      | 442 923          | 0,02              |
| 123 888 Aviva PLC   | 619 159          | 0,03              |
| 134 924 BAE Systems PLC   | 1 639 240        | 0,07              |
| 748 859 Barclays PLC  | 1 350 001        | 0,06              |
| 50 955 Barratt Developments PLC                                   | 293 910          | 0,01              |
| 3 208 Berkeley Group Holdings PLC                                 | 166 475          | 0,01              |
| 776 481 BP PLC  | 4 904 089        | 0,22              |
| 87 094 British American Tobacco PLC                               | 3 058 860        | 0,14              |
| 378 812 BT Group PLC  | 682 901          | 0,03              |
| 14 687 Bunzl PLC  | 555 143          | 0,02              |
| 19 036 Burberry Group PLC   | 608 668          | 0,03              |
| 2 360 Coca-Cola HBC AG  | 64 576           | 0,00              |
| 75 855 Compass Group PLC  | 1 906 769        | 0,08              |
| 6 246 Croda International PLC                                     | 501 832          | 0,02              |
| 5 029 DCC PLC   | 293 370          | 0,01              |
| 95 835 Diageo PLC   | 4 282 416        | 0,19              |

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Livre sterling – 4,17 % (suite)</b>                            |                  |                   | <b>Livre sterling – 4,17 % (suite)</b>                            |                   |                   |
| 22 097 Entain PLC   | 343 299          | 0,01              | 47 950 SSE PLC  | 1 068 959         | 0,05              |
| 37 926 Experian PLC   | 1 247 370        | 0,06              | 27 435 St James's Place PLC                                       | 410 796           | 0,02              |
| 420 890 Glencore PLC  | 2 417 822        | 0,11              | 114 655 Standard Chartered PLC                                    | 870 722           | 0,04              |
| 164 257 GSK PLC   | 2 902 236        | 0,13              | 88 959 Taylor Wimpey PLC  | 130 837           | 0,01              |
| 146 610 Haleon PLC  | 583 709          | 0,03              | 323 344 Tesco PLC   | 1 062 265         | 0,05              |
| 17 516 Halma PLC  | 482 749          | 0,02              | 106 791 Unilever PLC  | 5 532 549         | 0,25              |
| 25 306 Hargreaves Lansdown PLC                                    | 250 129          | 0,01              | 29 027 United Utilities Group PLC                                 | 380 439           | 0,02              |
| 2 075 Hikma Pharmaceuticals PLC                                   | 42 974           | 0,00              | 1 120 696 Vodafone Group PLC                                      | 1 237 416         | 0,05              |
| 830 843 HSBC Holdings PLC   | 5 647 045        | 0,25              | 9 402 Whitbread PLC   | 347 242           | 0,02              |
| 41 326 Imperial Brands PLC  | 952 458          | 0,04              | 34 169 WPP PLC  | 404 992           | 0,02              |
| 71 627 Informa PLC  | 613 389          | 0,03              |   | <b>93 552 606</b> | <b>4,17</b>       |
| 8 324 InterContinental Hotels Group PLC                           | 546 722          | 0,02              | <b>Dollar de Singapour – 0,31 %</b>                               |                   |                   |
| 6 969 Intertek Group PLC  | 349 240          | 0,02              | 136 737 Capitaland Investment Ltd/Singapore                       | 378 468           | 0,02              |
| 36 551 J Sainsbury PLC  | 125 954          | 0,01              | 3 100 City Developments Ltd                                       | 17 184            | 0,00              |
| 27 750 JD Sports Fashion PLC                                      | 60 989           | 0,00              | 80 529 DBS Group Holdings Ltd                                     | 1 998 764         | 0,09              |
| 4 454 Johnson Matthey PLC   | 109 234          | 0,00              | 149 100 Genting Singapore Ltd                                     | 125 600           | 0,01              |
| 104 790 Kingfisher PLC  | 338 431          | 0,01              | 88 900 Keppel Corp Ltd  | 376 448           | 0,02              |
| 249 492 Legal & General Group PLC                                 | 736 969          | 0,03              | 161 989 Oversea-Chinese Banking Corp Ltd                          | 1 507 130         | 0,07              |
| 2 936 968 Lloyds Banking Group PLC                                | 1 731 277        | 0,08              | 360 707 Sembcorp Marine Ltd                                       | 32 285            | 0,00              |
| 13 429 London Stock Exchange Group PLC                            | 1 306 425        | 0,06              | 9 500 Singapore Airlines Ltd                                      | 40 942            | 0,00              |
| 57 476 M&G PLC  | 140 711          | 0,01              | 9 800 Singapore Exchange Ltd                                      | 69 287            | 0,00              |
| 213 334 Melrose Industries PLC                                    | 439 188          | 0,02              | 22 600 Singapore Technologies Engineering Ltd                     | 62 214            | 0,00              |
| 21 669 Mondi PLC  | 343 482          | 0,02              | 427 800 Singapore Telecommunications Ltd                          | 791 537           | 0,03              |
| 150 317 National Grid PLC   | 2 037 949        | 0,09              | 60 900 United Overseas Bank Ltd                                   | 1 363 156         | 0,06              |
| 203 416 NatWest Group PLC   | 662 990          | 0,03              | 3 500 UOL Group   | 18 243            | 0,00              |
| 6 102 Next PLC  | 495 845          | 0,02              | 1 600 Venture Corp Ltd  | 21 264            | 0,00              |
| 41 927 Ocado Group PLC  | 277 347          | 0,01              | 52 700 Wilmar International Ltd                                   | 166 874           | 0,01              |
| 16 969 Pearson PLC  | 177 166          | 0,01              |   | <b>6 969 396</b>  | <b>0,31</b>       |
| 14 869 Persimmon PLC  | 230 913          | 0,01              | <b>Couronne suédoise – 0,96 %</b>                                 |                   |                   |
| 6 315 Phoenix Group Holdings PLC                                  | 42 664           | 0,00              | 15 821 Alfa Laval AB  | 564 058           | 0,03              |
| 108 420 Prudential PLC  | 1 477 296        | 0,07              | 41 581 Assa Abloy AB  | 995 662           | 0,04              |
| 29 479 Reckitt Benckiser Group PLC                                | 2 244 549        | 0,10              | 110 626 Atlas Copco AB (Class A)                                  | 1 403 315         | 0,06              |
| 77 103 RELX PLC   | 2 495 844        | 0,11              | 93 133 Atlas Copco AB (Class B)                                   | 1 070 402         | 0,05              |
| 81 894 Rentokil Initial PLC                                       | 599 041          | 0,03              | 14 714 Boliden AB   | 578 653           | 0,03              |
| 45 784 Rio Tinto PLC  | 3 101 076        | 0,14              | 4 992 Electrolux AB   | 60 619            | 0,00              |
| 326 337 Rolls-Royce Holdings PLC                                  | 601 295          | 0,03              | 40 053 Embracer Group AB  | 187 218           | 0,01              |
| 49 812 Sage Group PLC   | 477 323          | 0,02              | 36 273 Epiroc AB (Class A)  | 719 895           | 0,03              |
| 8 364 Schroders PLC   | 47 572           | 0,00              | 19 255 Epiroc AB (Class B)  | 327 646           | 0,01              |
| 10 396 Severn Trent PLC   | 370 071          | 0,02              | 9 279 EQT AB  | 188 451           | 0,01              |
| 292 919 Shell PLC   | 8 360 919        | 0,37              | 18 158 Essity AB  | 519 023           | 0,02              |
| 38 387 Smith & Nephew PLC   | 532 542          | 0,02              | 7 007 Evolution AB  | 938 046           | 0,04              |
| 20 925 Smiths Group PLC   | 444 105          | 0,02              | 7 332 Fastighets AB Balder  | 30 058            | 0,00              |
| 3 357 Spirax-Sarco Engineering PLC                                | 492 073          | 0,02              | 6 361 Getinge AB  | 155 014           | 0,01              |

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                   |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                   |                   | <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Couronne suédoise – 0,96 % (suite)</b>                         |                   |                   | <b>Franc suisse – 2,84 % (suite)</b>                              |                   |                   |
| 34 947 H & M Hennes & Mauritz AB                                  | 498 176           | 0,02              | 1 530 Geberit AG  | 852 801           | 0,04              |
| 84 999 Hexagon AB   | 974 211           | 0,04              | 401 Givaudan SA   | 1 304 989         | 0,06              |
| 6 000 Holmen AB   | 230 984           | 0,01              | 22 622 Holcim AG  | 1 458 525         | 0,07              |
| 5 007 Husqvarna AB  | 43 380            | 0,00              | 10 205 Julius Baer Group Ltd                                      | 696 158           | 0,03              |
| 2 499 Industrivarden AB (Class A)                                 | 67 406            | 0,00              | 2 417 Kuehne + Nagel International AG                             | 719 372           | 0,03              |
| 4 737 Industrivarden AB (Class C)                                 | 127 544           | 0,01              | 7 608 Logitech International SA                                   | 442 214           | 0,02              |
| 6 075 Indutrade AB  | 128 946           | 0,01              | 3 150 Lonza Group AG  | 1 887 483         | 0,08              |
| 957 Investment AB Latour  | 19 436            | 0,00              | 115 758 Nestle SA   | 14 123 350        | 0,63              |
| 36 702 Investor AB (Class A)                                      | 747 522           | 0,03              | 90 205 Novartis AG  | 8 270 561         | 0,37              |
| 73 049 Investor AB (Class B)                                      | 1 451 533         | 0,06              | 1 157 Partners Group Holding AG                                   | 1 085 127         | 0,05              |
| 6 461 Kinnevik AB   | 96 265            | 0,00              | 29 306 Roche Holding AG (Non voting rights)                       | 8 371 081         | 0,37              |
| 514 L E Lundbergforetagen AB                                      | 23 233            | 0,00              | 1 613 Roche Holding AG (Voting rights)                            | 485 551           | 0,02              |
| 6 366 Lifco AB  | 136 903           | 0,01              | 2 411 Schindler Holding AG (Non voting rights)                    | 533 373           | 0,02              |
| 65 201 Nibe Industrier AB   | 740 695           | 0,03              | 228 Schindler Holding AG (Voting rights)                          | 48 168            | 0,00              |
| 134 400 Nordea Bank Abp   | 1 434 008         | 0,06              | 319 SGS SA  | 702 216           | 0,03              |
| 16 225 Sagax AB   | 373 645           | 0,02              | 4 537 SIG Group AG  | 116 808           | 0,01              |
| 48 248 Sandvik AB   | 1 022 697         | 0,05              | 5 972 Sika AG   | 1 670 238         | 0,07              |
| 5 966 Securitas AB  | 53 092            | 0,00              | 2 394 Sonova Holding AG   | 703 879           | 0,03              |
| 71 783 Skandinaviska Enskilda Banken AB                           | 791 586           | 0,04              | 4 150 Straumann Holding AG  | 619 400           | 0,03              |
| 17 521 Skanska AB   | 267 895           | 0,01              | 1 875 Swatch Group AG (BR)  | 643 232           | 0,03              |
| 20 001 SKF AB   | 393 479           | 0,02              | 1 481 Swiss Life Holding AG                                       | 913 031           | 0,04              |
| 25 793 Svenska Cellulosa AB SCA                                   | 339 403           | 0,02              | 4 520 Swiss Prime Site AG   | 376 275           | 0,02              |
| 66 570 Svenska Handelsbanken AB                                   | 576 751           | 0,03              | 12 214 Swiss Re AG  | 1 254 624         | 0,06              |
| 39 466 Swedbank AB  | 647 583           | 0,03              | 1 183 Swisscom AG   | 755 214           | 0,03              |
| 13 258 Tele2 AB   | 132 010           | 0,01              | 3 265 Temenos AG  | 226 161           | 0,01              |
| 124 370 Telefonaktiebolaget LM Ericsson                           | 726 822           | 0,03              | 146 254 UBS Group AG  | 3 088 216         | 0,14              |
| 136 461 Telia Co AB   | 347 023           | 0,02              | 907 VAT Group AG  | 325 847           | 0,01              |
| 62 771 Volvo AB (Class B)   | 1 294 519         | 0,06              | 5 914 Zurich Insurance Group AG                                   | 2 833 515         | 0,13              |
|   | <b>21 424 807</b> | <b>0,96</b>       |   | <b>63 628 040</b> | <b>2,84</b>       |
| <b>Franc suisse – 2,84 %</b>                                      |                   |                   | <b>Dollar américain – 66,01 %</b>                                 |                   |                   |
| 65 552 ABB Ltd  | 2 250 962         | 0,10              | 23 375 3M Co  | 2 456 946         | 0,11              |
| 8 131 Adecco Group AG   | 295 050           | 0,01              | 6 722 A O Smith Corp  | 464 826           | 0,02              |
| 20 391 Alcon Inc  | 1 444 144         | 0,06              | 72 428 Abbott Laboratories  | 7 334 059         | 0,33              |
| 1 645 Bachem Holding AG   | 164 581           | 0,01              | 74 614 AbbVie Inc   | 11 891 233        | 0,53              |
| 2 586 Baloise Holding AG  | 403 094           | 0,02              | 26 645 Accenture PLC  | 7 615 407         | 0,34              |
| 119 Barry Callebaut AG  | 252 576           | 0,01              | 31 233 Activision Blizzard Inc                                    | 2 673 232         | 0,12              |
| 22 Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG (Non voting rights)     | 260 084           | 0,01              | 19 663 Adobe Inc  | 7 577 530         | 0,34              |
| 3 Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG (Voting rights)          | 354 660           | 0,02              | 2 768 Advance Auto Parts Inc                                      | 336 616           | 0,01              |
| 21 553 Cie Financiere Richemont SA                                | 3 442 157         | 0,15              | 68 849 Advanced Micro Devices                                     | 6 747 891         | 0,30              |
| 1 292 Clariant AG   | 21 369            | 0,00              | 5 200 AECOM   | 438 464           | 0,02              |
| 133 858 Credit Suisse Group AG                                    | 120 532           | 0,01              | 2 700 AerCap Holdings NV  | 151 821           | 0,01              |
| 135 EMS-Chemie Holding AG   | 111 422           | 0,01              | 29 356 AES Corp   | 706 893           | 0,03              |
|   |                   |                   | 26 377 Aflac Inc  | 1 701 844         | 0,08              |

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 66,01 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 66,01 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 12 271 Agilent Technologies Inc                                   | 1 697 570        | 0,08              | 900 Aspen Technology Inc  | 205 983          | 0,01              |
| 8 689 Air Products and Chemicals Inc                              | 2 495 568        | 0,11              | 755 Assurant Inc  | 90 653           | 0,00              |
| 14 346 Airbnb Inc   | 1 784 642        | 0,08              | 302 370 AT&T Inc  | 5 820 623        | 0,26              |
| 6 644 Akamai Technologies Inc                                     | 520 225          | 0,02              | 5 900 Atlassian Corp  | 1 009 903        | 0,04              |
| 5 185 Albemarle   | 1 146 092        | 0,05              | 4 897 Atmos Energy Corp   | 550 227          | 0,02              |
| 5 100 Alcoa Corp  | 217 056          | 0,01              | 8 854 Autodesk Inc  | 1 843 049        | 0,08              |
| 2 869 Align Technology Inc  | 958 648          | 0,04              | 17 082 Automatic Data Processing                                  | 3 802 966        | 0,17              |
| 3 959 Allegion PLC  | 422 544          | 0,02              | 826 AutoZone  | 2 030 432        | 0,09              |
| 9 650 Alliant Energy Corp   | 515 310          | 0,02              | 26 483 Avantor Inc  | 559 851          | 0,02              |
| 12 352 Allstate   | 1 368 725        | 0,06              | 3 504 Avery Dennison Corp   | 626 971          | 0,03              |
| 19 188 Ally Financial Inc   | 489 102          | 0,02              | 2 700 Axon Enterprise Inc   | 607 095          | 0,03              |
| 5 054 Alnylam Pharmaceuticals Inc                                 | 1 012 417        | 0,05              | 38 104 Baker Hughes Co  | 1 099 681        | 0,05              |
| 249 603 Alphabet Inc (Class A)                                    | 25 891 319       | 1,15              | 12 626 Ball Corp  | 695 819          | 0,03              |
| 228 856 Alphabet Inc (Class C)                                    | 23 801 024       | 1,06              | 302 215 Bank of America Corp                                      | 8 643 349        | 0,39              |
| 76 648 Altria Group Inc   | 3 420 034        | 0,15              | 33 716 Bank of New York Mellon Corp                               | 1 532 055        | 0,07              |
| 381 211 Amazon.com Inc  | 39 375 284       | 1,76              | 8 307 Bath & Body Works Inc                                       | 303 870          | 0,01              |
| 67 145 Amcor PLC  | 764 110          | 0,03              | 20 143 Baxter International Inc                                   | 817 000          | 0,04              |
| 9 391 Ameren Corp   | 811 289          | 0,04              | 11 369 Becton Dickinson and Co                                    | 2 814 282        | 0,13              |
| 19 640 American Electric Power Co Inc                             | 1 787 044        | 0,08              | 9 900 Bentley Systems Inc   | 425 601          | 0,02              |
| 27 500 American Express   | 4 536 125        | 0,20              | 54 107 Berkshire Hathaway Inc                                     | 16 706 618       | 0,75              |
| 1 568 American Financial Group                                    | 190 512          | 0,01              | 9 583 Best Buy Co Inc   | 750 061          | 0,03              |
| 28 424 American International Group Inc                           | 1 431 433        | 0,06              | 4 964 BILL Holdings Inc   | 402 779          | 0,02              |
| 7 702 American Water Works Co Inc                                 | 1 128 266        | 0,05              | 6 778 Biogen Inc  | 1 884 487        | 0,08              |
| 4 989 Ameriprise Financial Inc                                    | 1 529 129        | 0,07              | 7 640 BioMarin Pharmaceutical                                     | 742 914          | 0,03              |
| 6 184 AmerisourceBergen Corp                                      | 990 120          | 0,04              | 822 Bio-Rad Laboratories Inc                                      | 393 754          | 0,02              |
| 8 912 AMETEK  | 1 295 181        | 0,06              | 4 386 Bio-Techne Corp   | 325 397          | 0,01              |
| 23 010 Amgen Inc  | 5 562 668        | 0,25              | 6 425 Black Knight Inc  | 369 823          | 0,02              |
| 23 109 Amphenol Corp  | 1 888 468        | 0,08              | 6 185 BlackRock Inc   | 4 138 507        | 0,18              |
| 22 341 Analog Devices   | 4 406 092        | 0,20              | 27 296 Blackstone Inc   | 2 397 681        | 0,11              |
| 3 499 ANSYS Inc   | 1 164 467        | 0,05              | 21 423 Block Inc  | 1 470 689        | 0,07              |
| 9 358 Aon PLC   | 2 950 484        | 0,13              | 23 942 Boeing Co  | 5 085 999        | 0,23              |
| 10 400 APA Corp   | 375 024          | 0,02              | 1 669 Booking Holdings Inc  | 4 426 872        | 0,20              |
| 14 052 Apollo Global Management Inc                               | 887 524          | 0,04              | 5 468 Booz Allen Hamilton Holding Corp                            | 506 829          | 0,02              |
| 663 689 Apple Inc   | 109 442 316      | 4,88              | 11 539 BorgWarner Inc   | 566 680          | 0,03              |
| 36 854 Applied Materials  | 4 526 777        | 0,20              | 57 767 Boston Scientific Corp                                     | 2 890 083        | 0,13              |
| 10 529 Aptiv PLC  | 1 181 249        | 0,05              | 91 116 Bristol-Myers Squibb Co                                    | 6 315 250        | 0,28              |
| 12 473 Aramark  | 446 533          | 0,02              | 17 427 Broadcom Inc   | 11 180 118       | 0,50              |
| 16 231 Arch Capital Group Ltd                                     | 1 101 598        | 0,05              | 4 844 Broadridge Financial Solutions Inc                          | 709 985          | 0,03              |
| 21 991 Archer-Daniels-Midland Co                                  | 1 751 803        | 0,08              | 9 949 Brown & Brown   | 571 272          | 0,03              |
| 3 400 Ares Management Corp  | 283 696          | 0,01              | 12 474 Brown-Forman   | 801 704          | 0,04              |
| 9 217 Arista Networks Inc   | 1 547 166        | 0,07              | 8 142 Bunge Ltd   | 777 724          | 0,03              |
| 4 285 Arrow Electronics Inc                                       | 535 068          | 0,02              | 2 759 Burlington Stores Inc                                       | 557 594          | 0,02              |
| 7 972 Arthur J Gallagher & Co                                     | 1 525 123        | 0,07              | 11 542 Cadence Design Systems Inc                                 | 2 424 859        | 0,11              |



## SPDR MSCI World UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation   | Investissement                               | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|--|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |  |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |  |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 66,01 % (suite)</b>                         |  |                  |                   |
| 6 739   | Caesars Entertainment Inc                    | 328 931          | 0,01              |
| 8 085   | Campbell Soup Co                             | 444 513          | 0,02              |
| 17 767  | Capital One Financial Corp                   | 1 708 475        | 0,08              |
| 12 439  | Cardinal Health Inc                          | 939 145          | 0,04              |
| 1 200   | Carlisle Cos Inc                             | 271 284          | 0,01              |
| 11 000  | Carlyle Group Inc                            | 341 660          | 0,02              |
| 6 991   | CarMax Inc                                   | 449 381          | 0,02              |
| 42 813  | Carnival Corp                                | 434 552          | 0,02              |
| 32 410  | Carrier Global Corp                          | 1 482 758        | 0,07              |
| 6 104   | Catalent Inc                                 | 401 094          | 0,02              |
| 22 445  | Caterpillar Inc                              | 5 136 314        | 0,23              |
| 4 684   | Cboe Global Markets Inc                      | 628 780          | 0,03              |
| 13 069  | CBRE Group Inc                               | 951 554          | 0,04              |
| 5 700   | CDW Corp/DE                                  | 1 110 873        | 0,05              |
| 4 828   | Celanese Corp                                | 525 721          | 0,02              |
| 23 072  | Centene Corp                                 | 1 458 381        | 0,06              |
| 21 357  | CenterPoint Energy Inc                       | 629 177          | 0,03              |
| 5 605   | Ceridian HCM Holding Inc                     | 410 398          | 0,02              |
| 10 082  | CF Industries Holdings Inc                   | 730 844          | 0,03              |
| 5 705   | CH Robinson Worldwide Inc                    | 566 906          | 0,03              |
| 1 881   | Charles River Laboratories International Inc | 379 623          | 0,02              |
| 62 767  | Charles Schwab Corp                          | 3 287 735        | 0,15              |
| 5 059   | Charter Communications Inc                   | 1 809 149        | 0,08              |
| 3 523   | Check Point Software Technologies Ltd        | 457 990          | 0,02              |
| 9 655   | Cheniere Energy Inc                          | 1 521 628        | 0,07              |
| 5 900   | Chesapeake Energy Corp                       | 448 636          | 0,02              |
| 77 890  | Chevron Corp                                 | 12 708 532       | 0,57              |
| 5 600   | Chewy Inc                                    | 209 328          | 0,01              |
| 1 100   | Chipotle Mexican Grill Inc                   | 1 879 119        | 0,08              |
| 17 967  | Chubb Ltd                                    | 3 488 832        | 0,16              |
| 10 087  | Church & Dwight Co Inc                       | 891 792          | 0,04              |
| 13 493  | Cigna Group                                  | 3 447 866        | 0,15              |
| 6 347   | Cincinnati Financial                         | 711 372          | 0,03              |
| 3 593   | Cintas Corp                                  | 1 662 409        | 0,07              |
| 169 688   | Cisco Systems Inc                            | 8 870 440        | 0,40              |
| 81 906  | Citigroup Inc                                | 3 840 572        | 0,17              |
| 17 885  | Citizens Financial Group Inc                 | 543 167          | 0,02              |
| 24 616  | Clarivate PLC                                | 231 144          | 0,01              |
| 14 500  | Cleveland-Cliffs Inc                         | 265 785          | 0,01              |
| 5 191   | Clorox Co                                    | 821 424          | 0,04              |
| 10 464  | Cloudflare Inc                               | 645 210          | 0,03              |
| 14 453  | CME Group Inc                                | 2 768 039        | 0,12              |
| 11 035  | CMS Energy Corp                              | 677 328          | 0,03              |

| Participation   | Investissement                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|-------------------------------------|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                                     |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                                     |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 66,01 % (suite)</b>                         |                                     |                  |                   |
| 170 675   | Coca-Cola                           | 10 586 970       | 0,47              |
| 10 808  | Coca-Cola Europacific Partners PLC  | 639 726          | 0,03              |
| 7 680   | Cognex Corp                         | 380 544          | 0,02              |
| 21 752  | Cognizant Technology Solutions Corp | 1 325 349        | 0,06              |
| 5 000   | Coinbase Global Inc                 | 337 850          | 0,02              |
| 31 354  | Colgate-Palmolive                   | 2 356 253        | 0,11              |
| 187 713   | Comcast Corp                        | 7 116 200        | 0,32              |
| 20 125  | Conagra Brands Inc                  | 755 895          | 0,03              |
| 51 885  | ConocoPhillips                      | 5 147 511        | 0,23              |
| 13 176  | Consolidated Edison Inc             | 1 260 548        | 0,06              |
| 6 826   | Constellation Brands Inc            | 1 541 925        | 0,07              |
| 14 511  | Constellation Energy Corp           | 1 139 114        | 0,05              |
| 2 041   | Cooper Cos Inc                      | 762 028          | 0,03              |
| 16 974  | Copart                              | 1 276 615        | 0,06              |
| 30 618  | Coming Inc                          | 1 080 203        | 0,05              |
| 30 710  | Corteva Inc                         | 1 852 120        | 0,08              |
| 15 537  | CoStar Group Inc                    | 1 069 722        | 0,05              |
| 18 394  | Costco Wholesale Corp               | 9 139 427        | 0,41              |
| 34 197  | Coterra Energy Inc                  | 839 194          | 0,04              |
| 8 851   | Crowdstrike Holdings Inc            | 1 214 888        | 0,05              |
| 7 050   | Crown Holdings Inc                  | 583 106          | 0,03              |
| 90 812  | CSX Corp                            | 2 718 911        | 0,12              |
| 6 001   | Cummins Inc                         | 1 433 519        | 0,06              |
| 53 678  | CVS Health Corp                     | 3 988 812        | 0,18              |
| 1 401   | CyberArk Software Ltd               | 207 320          | 0,01              |
| 29 043  | Danaher Corp                        | 7 319 998        | 0,33              |
| 5 259   | Darden Restaurants Inc              | 815 986          | 0,04              |
| 4 700   | Darling Ingredients                 | 274 480          | 0,01              |
| 10 619  | Datadog Inc                         | 771 577          | 0,03              |
| 4 254   | DaVita Inc                          | 345 042          | 0,02              |
| 11 945  | Deere & Co                          | 4 931 852        | 0,22              |
| 9 669   | Dell Technologies Inc               | 388 791          | 0,02              |
| 9 828   | Delta Air Lines Inc                 | 343 194          | 0,02              |
| 9 317   | DENTSPLY SIRONA Inc                 | 365 972          | 0,02              |
| 29 086  | Devon Energy Corp                   | 1 472 042        | 0,07              |
| 15 804  | Dexcom Inc                          | 1 836 109        | 0,08              |
| 6 372   | Diamondback Energy Inc              | 861 303          | 0,04              |
| 12 276  | Discover Financial Services         | 1 213 360        | 0,05              |
| 12 157  | DISH Network Corp                   | 113 425          | 0,00              |
| 7 806   | DocuSign Inc                        | 455 090          | 0,02              |
| 10 003  | Dollar General Corp                 | 2 105 231        | 0,09              |
| 9 675   | Dollar Tree Inc                     | 1 388 846        | 0,06              |
| 34 696  | Dominion Energy Inc                 | 1 939 853        | 0,09              |

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 66,01 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 66,01 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 1 455 Domino's Pizza Inc  | 479 961          | 0,02              | 1 104 Fair Isaac Corp   | 775 770          | 0,03              |
| 9 436 DoorDash Inc  | 599 752          | 0,03              | 22 879 Fastenal Co  | 1 234 093        | 0,05              |
| 5 331 Dover Corp  | 809 992          | 0,04              | 10 055 FedEx Corp   | 2 297 467        | 0,10              |
| 31 979 Dow Inc  | 1 753 089        | 0,08              | 7 964 Ferguson PLC  | 1 065 185        | 0,05              |
| 14 004 DR Horton  | 1 368 051        | 0,06              | 12 001 Fidelity National Financial Inc                            | 419 195          | 0,02              |
| 15 912 Dropbox Inc  | 344 017          | 0,02              | 25 157 Fidelity National Information Services Inc                 | 1 366 780        | 0,06              |
| 7 075 DTE Energy Co   | 774 996          | 0,03              | 28 304 Fifth Third Bancorp  | 754 019          | 0,03              |
| 30 028 Duke Energy Corp   | 2 896 801        | 0,13              | 500 First Citizens BancShares Inc/NC                              | 486 550          | 0,02              |
| 20 584 DuPont de Nemours Inc                                      | 1 477 314        | 0,07              | 12 200 First Horizon Corp   | 216 916          | 0,01              |
| 9 609 Dynatrace Inc   | 406 461          | 0,02              | 7 044 First Republic Bank/CA                                      | 98 546           | 0,00              |
| 5 778 Eastman Chemical Co   | 487 317          | 0,02              | 3 300 First Solar Inc   | 717 750          | 0,03              |
| 16 327 Eaton Corp PLC   | 2 797 468        | 0,12              | 21 507 FirstEnergy Corp   | 861 570          | 0,04              |
| 22 680 eBay   | 1 006 312        | 0,04              | 26 111 Fiserv Inc   | 2 951 326        | 0,13              |
| 10 246 Ecolab Inc   | 1 696 020        | 0,08              | 3 588 FleetCor Technologies Inc                                   | 756 530          | 0,03              |
| 14 903 Edison International                                       | 1 052 003        | 0,05              | 5 181 FMC   | 632 756          | 0,03              |
| 25 061 Edwards Lifesciences Corp                                  | 2 073 297        | 0,09              | 156 176 Ford Motor Co   | 1 967 818        | 0,09              |
| 19 401 Elanco Animal Health Inc                                   | 182 369          | 0,01              | 28 420 Fortinet Inc   | 1 888 793        | 0,08              |
| 12 010 Electronic Arts Inc  | 1 446 605        | 0,06              | 12 058 Fortive Corp   | 821 994          | 0,04              |
| 10 149 Elevance Health Inc  | 4 666 612        | 0,21              | 5 881 Fortune Brands Innovations Inc                              | 345 391          | 0,02              |
| 33 562 Eli Lilly & Co   | 11 525 862       | 0,51              | 16 505 Fox Corp (Class A)   | 561 995          | 0,03              |
| 24 591 Emerson Electric Co  | 2 142 860        | 0,10              | 8 629 Fox Corp (Class B)  | 270 174          | 0,01              |
| 5 798 Enphase Energy Inc  | 1 219 203        | 0,05              | 16 860 Franklin Resources Inc                                     | 454 208          | 0,02              |
| 5 071 Entegris Inc  | 415 873          | 0,02              | 59 791 Freeport-McMoRan Inc                                       | 2 446 050        | 0,11              |
| 7 782 Entergy Corp  | 838 433          | 0,04              | 5 558 Garmin Ltd  | 560 913          | 0,02              |
| 23 987 EOG Resources Inc  | 2 749 630        | 0,12              | 3 598 Gartner   | 1 172 120        | 0,05              |
| 2 299 EPAM Systems Inc  | 687 401          | 0,03              | 13 621 GE HealthCare Technologies Inc                             | 1 117 331        | 0,05              |
| 11 700 EQT Corp   | 373 347          | 0,02              | 24 307 Gen Digital Inc  | 417 108          | 0,02              |
| 4 901 Equifax Inc   | 994 119          | 0,04              | 2 324 Generac Holdings Inc  | 251 015          | 0,01              |
| 19 459 Equitable Holdings Inc                                     | 494 064          | 0,02              | 9 715 General Dynamics Corp                                       | 2 217 060        | 0,10              |
| 292 Erie Indemnity Co   | 67 645           | 0,00              | 44 012 General Electric Co  | 4 207 547        | 0,19              |
| 9 582 Essential Utilities Inc                                     | 418 254          | 0,02              | 24 653 General Mills Inc  | 2 106 845        | 0,09              |
| 9 214 Estee Lauder  | 2 270 882        | 0,10              | 52 801 General Motors Co  | 1 936 741        | 0,09              |
| 6 954 Etsy Inc  | 774 189          | 0,03              | 5 575 Genuine Parts Co  | 932 753          | 0,04              |
| 1 642 Everest Re Group  | 587 869          | 0,03              | 52 388 Gilead Sciences Inc  | 4 346 632        | 0,19              |
| 9 343 Evergy Inc  | 571 044          | 0,03              | 13 316 Global Payments Inc  | 1 401 376        | 0,06              |
| 13 158 Eversource Energy  | 1 029 745        | 0,05              | 4 730 Globe Life Inc  | 520 395          | 0,02              |
| 8 466 Exact Sciences Corp   | 574 079          | 0,03              | 7 085 GoDaddy Inc   | 550 646          | 0,02              |
| 38 212 Exelon Corp  | 1 600 701        | 0,07              | 14 458 Goldman Sachs Group Inc                                    | 4 729 356        | 0,21              |
| 5 527 Expedia Group Inc   | 536 285          | 0,02              | 51 700 Grab Holdings Ltd  | 155 617          | 0,01              |
| 7 023 Expeditors International of Washington                      | 773 373          | 0,03              | 6 700 Graco Inc   | 489 167          | 0,02              |
| 171 278 Exxon Mobil Corp  | 18 782 346       | 0,84              | 36 897 Halliburton Co   | 1 167 421        | 0,05              |
| 2 718 F5 Networks   | 395 985          | 0,02              | 14 207 Hartford Financial Services Group Inc                      | 990 086          | 0,04              |
| 1 294 FactSet Research Systems Inc                                | 537 126          | 0,02              | 5 239 Hasbro Inc  | 281 282          | 0,01              |

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 66,01 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 66,01 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 8 745 HCA Healthcare Inc  | 2 305 882        | 0,10              | 3 113 Jazz Pharmaceuticals PLC                                    | 455 525          | 0,02              |
| 4 617 HEICO (Restricted voting rights)                            | 627 450          | 0,03              | 3 487 JB Hunt Transport Services Inc                              | 611 829          | 0,03              |
| 901 HEICO Corp (Voting rights)                                    | 154 107          | 0,01              | 110 086 Johnson & Johnson   | 17 063 330       | 0,76              |
| 6 225 Henry Schein Inc  | 507 587          | 0,02              | 30 038 Johnson Controls International PLC                         | 1 808 888        | 0,08              |
| 5 738 Hershey Co  | 1 459 805        | 0,07              | 121 364 JPMorgan Chase & Co                                       | 15 814 943       | 0,71              |
| 11 530 Hess Corp  | 1 525 880        | 0,07              | 20 878 Juniper Networks Inc                                       | 718 621          | 0,03              |
| 54 157 Hewlett Packard Enterprise Co                              | 862 721          | 0,04              | 10 334 Kellogg Co   | 691 965          | 0,03              |
| 4 300 HF Sinclair Corp  | 208 034          | 0,01              | 28 983 Keurig Dr Pepper Inc                                       | 1 022 520        | 0,05              |
| 11 356 Hilton Worldwide Holdings Inc                              | 1 599 720        | 0,07              | 40 272 KeyCorp  | 504 205          | 0,02              |
| 10 542 Hologic  | 850 739          | 0,04              | 7 647 Keysight Technologies Inc                                   | 1 234 838        | 0,06              |
| 42 192 Home Depot Inc   | 12 451 703       | 0,56              | 13 887 Kimberly-Clark Corp  | 1 863 913        | 0,08              |
| 28 774 Honeywell International Inc                                | 5 499 287        | 0,25              | 84 685 Kinder Morgan Inc  | 1 482 834        | 0,07              |
| 66 400 Hongkong Land Holdings Ltd                                 | 291 496          | 0,01              | 20 157 KKR & Co Inc   | 1 058 646        | 0,05              |
| 8 577 Horizon Therapeutics PLC                                    | 936 094          | 0,04              | 6 195 KLA Corp  | 2 472 858        | 0,11              |
| 12 129 Hormel Foods Corp  | 483 705          | 0,02              | 2 393 Knight-Swift Transportation Holdings Inc                    | 135 396          | 0,01              |
| 14 263 Howmet Aerospace Inc                                       | 604 323          | 0,03              | 26 674 Kraft Heinz Co   | 1 031 484        | 0,05              |
| 51 221 HP Inc   | 1 503 336        | 0,07              | 30 841 Kroger Co  | 1 522 620        | 0,07              |
| 1 600 Hubbell Inc   | 389 296          | 0,02              | 8 531 L3Harris Technologies Inc                                   | 1 674 123        | 0,07              |
| 2 293 HubSpot Inc   | 983 124          | 0,04              | 3 959 Laboratory Corp of America Holdings                         | 908 274          | 0,04              |
| 5 350 Humana  | 2 597 211        | 0,12              | 5 993 Lam Research  | 3 177 009        | 0,14              |
| 50 357 Huntington Bancshares                                      | 563 998          | 0,03              | 6 100 Lamb Weston Holdings Inc                                    | 637 572          | 0,03              |
| 973 Huntington Ingalls Industries Inc                             | 201 430          | 0,01              | 14 993 Las Vegas Sands Corp                                       | 861 348          | 0,04              |
| 3 128 IDEX Corp   | 722 662          | 0,03              | 3 098 Lear Corp   | 432 140          | 0,02              |
| 3 336 IDEXX Laboratories Inc                                      | 1 668 267        | 0,07              | 5 631 Leidos Holdings Inc   | 518 390          | 0,02              |
| 12 366 Illinois Tool Works Inc                                    | 3 010 503        | 0,13              | 11 201 Lennar   | 1 177 337        | 0,05              |
| 6 497 Illumina Inc  | 1 510 877        | 0,07              | 1 619 Lennox International Inc                                    | 406 822          | 0,02              |
| 7 827 Incyte Corp   | 565 657          | 0,03              | 4 352 Liberty Broadband Corp                                      | 355 558          | 0,02              |
| 18 640 Ingersoll Rand Inc   | 1 084 475        | 0,05              | 3 766 Liberty Global PLC (Class A)                                | 73 437           | 0,00              |
| 2 779 Insulet Corp  | 886 390          | 0,04              | 20 416 Liberty Global PLC (Class C)                               | 416 078          | 0,02              |
| 172 233 Intel Corp  | 5 626 852        | 0,25              | 300 Liberty Media Corp  | 8 427            | 0,00              |
| 24 405 Intercontinental Exchange Inc                              | 2 545 197        | 0,11              | 10 199 Liberty Media Corp-Liberty Formula One                     | 763 191          | 0,03              |
| 36 636 International Business Machines Corp                       | 4 802 613        | 0,21              | 11 051 Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM                        | 309 318          | 0,01              |
| 8 480 International Flavors & Fragrances Inc                      | 779 821          | 0,03              | 7 418 Live Nation Entertainment Inc                               | 519 260          | 0,02              |
| 14 895 International Paper Co                                     | 537 114          | 0,02              | 12 670 LKQ Corp   | 719 149          | 0,03              |
| 19 922 Interpublic Group  | 741 895          | 0,03              | 9 980 Lockheed Martin Corp  | 4 717 845        | 0,21              |
| 11 084 Intuit   | 4 941 580        | 0,22              | 10 888 Loews Corp   | 631 722          | 0,03              |
| 14 703 Intuitive Surgical Inc                                     | 3 756 175        | 0,17              | 26 433 Lowe's Cos Inc   | 5 285 807        | 0,24              |
| 20 305 Invesco Ltd  | 333 002          | 0,01              | 2 400 LPL Financial Holdings Inc                                  | 485 760          | 0,02              |
| 7 690 IQVIA Holdings Inc  | 1 529 464        | 0,07              | 23 777 Lucid Group Inc  | 191 167          | 0,01              |
| 4 824 J M Smucker Co  | 759 153          | 0,03              | 4 791 Lululemon Athletica Inc                                     | 1 744 834        | 0,08              |
| 3 275 Jack Henry & Associates Inc                                 | 493 608          | 0,02              | 11 024 LyondellBasell Industries NV                               | 1 035 043        | 0,05              |
| 5 450 Jacobs Solutions Inc  | 640 430          | 0,03              | 7 721 M&T Bank  | 923 200          | 0,04              |
| 8 734 Jardine Matheson Holdings Ltd                               | 424 210          | 0,02              | 21 200 Marathon Oil Corp  | 507 952          | 0,02              |

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 66,01 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 66,01 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 18 900 Marathon Petroleum Corp                                    | 2 548 287        | 0,11              | 30 049 Newmont Mining   | 1 473 002        | 0,07              |
| 688 Markel Corp   | 878 858          | 0,04              | 18 398 News   | 317 733          | 0,01              |
| 1 461 MarketAxess Holdings Inc                                    | 571 675          | 0,03              | 80 989 NextEra Energy Inc   | 6 242 632        | 0,28              |
| 11 377 Marriott International Inc/MD                              | 1 889 037        | 0,08              | 51 317 Nike   | 6 293 517        | 0,28              |
| 20 164 Marsh & McLennan Cos Inc                                   | 3 358 314        | 0,15              | 16 045 NiSource Inc   | 448 618          | 0,02              |
| 2 497 Martin Marietta Materials Inc                               | 886 585          | 0,04              | 2 140 Nordson Corp  | 475 636          | 0,02              |
| 36 328 Marvell Technology Inc                                     | 1 573 002        | 0,07              | 10 260 Norfolk Southern Corp                                      | 2 175 120        | 0,10              |
| 10 525 Masco Corp   | 523 303          | 0,02              | 8 297 Northern Trust Corp   | 731 215          | 0,03              |
| 2 288 Masimo Corp   | 422 228          | 0,02              | 6 338 Northrop Grumman Corp                                       | 2 926 381        | 0,13              |
| 36 254 Mastercard Inc   | 13 175 066       | 0,59              | 3 200 Novocure Ltd  | 192 448          | 0,01              |
| 10 166 Match Group Inc  | 390 273          | 0,02              | 10 974 NRG Energy Inc   | 376 298          | 0,02              |
| 9 897 McCormick & Co Inc/MD                                       | 823 529          | 0,04              | 11 806 Nucor Corp   | 1 823 673        | 0,08              |
| 30 081 McDonald's Corp  | 8 410 948        | 0,38              | 103 606 NVIDIA Corp   | 28 778 639       | 1,28              |
| 6 519 McKesson Corp   | 2 321 090        | 0,10              | 122 NVR Inc   | 679 807          | 0,03              |
| 55 141 Medtronic PLC  | 4 445 467        | 0,20              | 11 647 NXP Semiconductors NV                                      | 2 171 874        | 0,10              |
| 1 921 MercadoLibre Inc  | 2 531 993        | 0,11              | 30 727 Occidental Petroleum Corp                                  | 1 918 287        | 0,09              |
| 104 462 Merck & Co Inc  | 11 113 712       | 0,50              | 5 421 Okta Inc  | 467 507          | 0,02              |
| 93 683 Meta Platforms Inc   | 19 855 175       | 0,89              | 3 958 Old Dominion Freight Line                                   | 1 349 045        | 0,06              |
| 29 700 MetLife Inc  | 1 720 818        | 0,08              | 9 213 Omnicom Group Inc   | 869 154          | 0,04              |
| 929 Mettler-Toledo International Inc                              | 1 421 565        | 0,06              | 20 087 ON Semiconductor Corp                                      | 1 653 562        | 0,07              |
| 18 024 MGM Resorts International                                  | 800 626          | 0,04              | 17 497 ONEOK Inc  | 1 111 759        | 0,05              |
| 21 089 Microchip Technology Inc                                   | 1 766 836        | 0,08              | 68 571 Oracle Corp  | 6 371 617        | 0,28              |
| 45 936 Micron Technology Inc                                      | 2 771 778        | 0,12              | 2 855 O'Reilly Automotive Inc                                     | 2 423 838        | 0,11              |
| 295 088 Microsoft Corp  | 85 073 870       | 3,80              | 16 178 Otis Worldwide Corp  | 1 365 423        | 0,06              |
| 13 672 Moderna Inc  | 2 099 746        | 0,09              | 8 000 Ovintiv Inc   | 288 640          | 0,01              |
| 3 446 Mohawk Industries Inc                                       | 345 358          | 0,02              | 2 355 Owens Corning   | 225 609          | 0,01              |
| 2 388 Molina Healthcare Inc                                       | 638 766          | 0,03              | 20 869 PACCAR Inc   | 1 527 611        | 0,07              |
| 9 404 Molson Coors Beverage Co                                    | 485 999          | 0,02              | 3 958 Packaging Corp of America                                   | 549 489          | 0,02              |
| 58 012 Mondelez International Inc                                 | 4 044 597        | 0,18              | 80 732 Palantir Technologies Inc                                  | 682 185          | 0,03              |
| 2 713 MongoDB Inc   | 632 455          | 0,03              | 11 853 Palo Alto Networks Inc                                     | 2 367 518        | 0,11              |
| 1 541 Monolithic Power Systems Inc                                | 771 332          | 0,03              | 24 051 Paramount Global   | 536 578          | 0,02              |
| 32 544 Monster Beverage Corp                                      | 1 757 701        | 0,08              | 5 259 Parker-Hannifin Corp  | 1 767 603        | 0,08              |
| 6 916 Moody's Corp  | 2 116 434        | 0,09              | 12 289 Paychex  | 1 408 197        | 0,06              |
| 52 187 Morgan Stanley   | 4 582 019        | 0,20              | 2 024 Paycom Software Inc   | 615 316          | 0,03              |
| 16 419 Mosaic Co  | 753 304          | 0,03              | 1 500 Paylocity Holding Corp                                      | 298 170          | 0,01              |
| 6 916 Motorola Solutions Inc                                      | 1 978 875        | 0,09              | 46 364 PayPal Holdings Inc  | 3 520 882        | 0,16              |
| 3 584 MSCI Inc  | 2 005 929        | 0,09              | 8 565 Pentair PLC   | 473 388          | 0,02              |
| 13 596 Nasdaq Inc   | 743 293          | 0,03              | 56 389 PepsiCo  | 10 279 715       | 0,46              |
| 9 243 NetApp Inc  | 590 166          | 0,03              | 4 385 PerkinElmer   | 584 345          | 0,03              |
| 17 950 Netflix Inc  | 6 201 366        | 0,28              | 233 608 Pfizer Inc  | 9 531 206        | 0,43              |
| 3 041 Neurocrine Biosciences                                      | 307 810          | 0,01              | 63 100 PG&E Corp  | 1 020 327        | 0,05              |
| 20 194 New Linde PLC  | 7 177 755        | 0,32              | 64 006 Philip Morris International Inc                            | 6 224 584        | 0,28              |
| 23 386 Newell Brands Inc  | 290 922          | 0,01              | 19 844 Phillips 66  | 2 011 785        | 0,09              |

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 66,01 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 66,01 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 30 248 Pinterest Inc  | 824 863          | 0,04              | 6 780 SEI Investments Co  | 390 189          | 0,02              |
| 8 845 Pioneer Natural Resources Co                                | 1 806 503        | 0,08              | 13 320 Sempra Energy  | 2 013 451        | 0,09              |
| 29 066 Plug Power Inc   | 340 654          | 0,02              | 9 092 Sensata Technologies Holding PLC                            | 454 782          | 0,02              |
| 17 606 PNC Financial Services Group Inc                           | 2 237 723        | 0,10              | 8 189 ServiceNow Inc  | 3 805 592        | 0,17              |
| 1 201 Pool Corp   | 411 270          | 0,02              | 9 984 Sherwin-Williams  | 2 244 104        | 0,10              |
| 9 350 PPG Industries Inc  | 1 248 973        | 0,06              | 17 002 Sirius XM Holdings Inc                                     | 67 498           | 0,00              |
| 25 977 PPL Corp   | 721 901          | 0,03              | 6 820 Skyworks Solutions Inc                                      | 804 624          | 0,04              |
| 11 302 Principal Financial Group Inc                              | 839 965          | 0,04              | 56 739 Snap Inc   | 636 044          | 0,03              |
| 99 071 Procter & Gamble Co  | 14 730 867       | 0,66              | 2 449 Snap-on   | 604 634          | 0,03              |
| 23 557 Progressive  | 3 370 064        | 0,15              | 8 885 Snowflake Inc   | 1 370 867        | 0,06              |
| 14 913 Prudential Financial Inc                                   | 1 233 902        | 0,05              | 2 035 SolarEdge Technologies Inc                                  | 618 538          | 0,03              |
| 5 062 PTC Inc   | 649 100          | 0,03              | 44 806 Southern Co  | 3 117 602        | 0,14              |
| 19 596 Public Service Enterprise Group Inc                        | 1 223 770        | 0,05              | 9 275 Southwest Airlines Co                                       | 301 809          | 0,01              |
| 11 284 PulteGroup   | 657 632          | 0,03              | 6 660 Splunk Inc  | 638 561          | 0,03              |
| 5 059 Qorvo Inc   | 513 843          | 0,02              | 8 700 SS&C Technologies Holdings Inc                              | 491 289          | 0,02              |
| 47 133 QUALCOMM Inc   | 6 013 228        | 0,27              | 6 363 Stanley Black & Decker Inc                                  | 512 731          | 0,02              |
| 4 700 Quanta Services Inc   | 783 208          | 0,03              | 48 966 Starbucks Corp   | 5 098 830        | 0,23              |
| 5 527 Quest Diagnostics   | 781 960          | 0,03              | 14 784 State Street Corp  | 1 119 001        | 0,05              |
| 7 918 Raymond James Financial Inc                                 | 738 512          | 0,03              | 6 773 Steel Dynamics Inc  | 765 755          | 0,03              |
| 61 277 Raytheon Technologies Corp                                 | 6 000 857        | 0,27              | 3 511 STERIS PLC  | 671 584          | 0,03              |
| 4 215 Regeneron Pharmaceuticals Inc                               | 3 463 339        | 0,15              | 13 618 Stryker  | 3 887 530        | 0,17              |
| 40 486 Regions Financial Corp                                     | 751 420          | 0,03              | 22 780 Synchrony Financial  | 662 442          | 0,03              |
| 2 300 Reliance Steel & Aluminum Co                                | 590 502          | 0,03              | 6 000 Synopsys Inc  | 2 317 500        | 0,10              |
| 2 000 Repligen Corp   | 336 720          | 0,01              | 19 684 Sysco Corp   | 1 520 195        | 0,07              |
| 8 297 Republic Services Inc                                       | 1 121 920        | 0,05              | 9 490 T Rowe Price Group Inc                                      | 1 071 421        | 0,05              |
| 5 983 ResMed Inc  | 1 310 217        | 0,06              | 5 696 Take-Two Interactive Software Inc                           | 679 533          | 0,03              |
| 10 071 Rivian Automotive Inc                                      | 155 899          | 0,01              | 6 500 Targa Resources Corp  | 474 175          | 0,02              |
| 6 201 Robert Half International Inc                               | 499 615          | 0,02              | 19 803 Target   | 3 279 971        | 0,15              |
| 14 200 ROBLOX Corp  | 638 716          | 0,03              | 13 185 TE Connectivity Ltd  | 1 729 213        | 0,08              |
| 4 535 Rockwell Automation Inc                                     | 1 330 796        | 0,06              | 1 891 Teledyne Technologies Inc                                   | 845 958          | 0,04              |
| 6 071 Roku Inc  | 399 593          | 0,02              | 1 927 Teleflex Inc  | 488 128          | 0,02              |
| 12 153 Rollins Inc  | 456 102          | 0,02              | 6 756 Teradyne Inc  | 726 338          | 0,03              |
| 4 157 Roper Technologies  | 1 831 948        | 0,08              | 111 853 Tesla Inc   | 23 205 023       | 1,04              |
| 14 785 Ross Stores  | 1 569 132        | 0,07              | 37 659 Texas Instruments Inc                                      | 7 004 951        | 0,31              |
| 7 896 Royal Caribbean Cruises Ltd                                 | 515 609          | 0,02              | 200 Texas Pacific Land Corp                                       | 340 204          | 0,02              |
| 18 616 Royalty Pharma PLC   | 670 734          | 0,03              | 11 276 Textron Inc  | 796 424          | 0,04              |
| 6 959 RPM International Inc                                       | 607 103          | 0,03              | 16 029 Thermo Fisher Scientific                                   | 9 238 635        | 0,41              |
| 14 227 S&P Global Inc   | 4 905 043        | 0,22              | 49 827 TJX Cos Inc  | 3 904 444        | 0,17              |
| 41 101 Salesforce Inc   | 8 211 158        | 0,37              | 25 073 T-Mobile US Inc  | 3 631 573        | 0,16              |
| 58 672 Schlumberger Ltd   | 2 880 795        | 0,13              | 8 600 Toast Inc   | 152 650          | 0,01              |
| 9 470 Seagate Technology Holdings PLC                             | 626 156          | 0,03              | 4 100 Toro Co   | 455 756          | 0,02              |
| 5 318 Seagen Inc  | 1 076 735        | 0,05              | 4 789 Tractor Supply Co   | 1 125 607        | 0,05              |
| 9 413 Sealed Air Corp   | 432 151          | 0,02              | 20 078 Trade Desk Inc   | 1 222 951        | 0,05              |

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 66,01 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 7 269 Tradeweb Markets Inc  | 574 396          | 0,03              |
| 10 398 Trane Technologies PLC                                     | 1 913 024        | 0,09              |
| 2 035 TransDigm Group Inc   | 1 499 897        | 0,07              |
| 7 578 TransUnion  | 470 897          | 0,02              |
| 10 240 Travelers Cos Inc  | 1 755 238        | 0,08              |
| 10 424 Trimble Inc  | 546 426          | 0,02              |
| 55 504 Truist Financial Corp                                      | 1 892 686        | 0,08              |
| 7 202 Twilio Inc  | 479 869          | 0,02              |
| 1 511 Tyler Technologies Inc                                      | 535 861          | 0,02              |
| 11 891 Tyson Foods Inc  | 705 374          | 0,03              |
| 61 880 Uber Technologies Inc                                      | 1 961 596        | 0,09              |
| 8 371 UGI Corp  | 290 976          | 0,01              |
| 1 143 U-Haul Holding Co   | 59 265           | 0,00              |
| 2 294 Ulta Beauty Inc   | 1 251 767        | 0,06              |
| 27 050 Union Pacific  | 5 444 083        | 0,24              |
| 30 167 United Parcel Service                                      | 5 852 096        | 0,26              |
| 2 877 United Rentals Inc  | 1 138 602        | 0,05              |
| 1 800 United Therapeutics Corp                                    | 403 128          | 0,02              |
| 38 922 UnitedHealth Group Inc                                     | 18 394 148       | 0,82              |
| 11 791 Unity Software Inc   | 382 500          | 0,02              |
| 3 468 Universal Health Services Inc                               | 440 783          | 0,02              |
| 60 677 US Bancorp   | 2 187 406        | 0,10              |
| 1 908 Vail Resorts Inc  | 445 861          | 0,02              |
| 16 930 Valero Energy Corp   | 2 363 428        | 0,11              |
| 5 692 Veeva Systems Inc   | 1 046 133        | 0,05              |
| 4 166 VeriSign Inc  | 880 401          | 0,04              |
| 6 190 Verisk Analytics Inc  | 1 187 613        | 0,05              |
| 174 953 Verizon Communications Inc                                | 6 803 922        | 0,30              |
| 10 528 Vertex Pharmaceuticals Inc                                 | 3 317 057        | 0,15              |
| 13 866 VF Corp  | 317 670          | 0,01              |
| 50 567 Viatis Inc   | 486 455          | 0,02              |
| 68 991 Visa Inc   | 15 554 711       | 0,69              |
| 20 140 Vistra Corp  | 483 360          | 0,02              |
| 7 367 VMware Inc  | 919 770          | 0,04              |
| 5 268 Vulcan Materials Co   | 903 778          | 0,04              |
| 9 500 W. R. Berkley   | 591 470          | 0,03              |
| 31 003 Walgreens Boots Alliance Inc                               | 1 072 084        | 0,05              |
| 63 718 Walmart Inc  | 9 395 219        | 0,42              |
| 74 421 Walt Disney Co   | 7 451 775        | 0,33              |
| 82 576 Warner Bros Discovery Inc                                  | 1 246 898        | 0,06              |
| 11 221 Waste Connections Inc                                      | 1 560 504        | 0,07              |
| 16 528 Waste Management Inc                                       | 2 696 874        | 0,12              |
| 2 520 Waters Corp   | 780 268          | 0,03              |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD     | % des actifs nets |
|---|----------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b>         |                      |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,09 % (mars 2022 : 96,80 %) (suite)</b>         |                      |                   |
| <b>Dollar américain – 66,01 % (suite)</b>                                 |                      |                   |
| 2 900 Webster Financial Corp  | 114 318              | 0,01              |
| 12 313 WEC Energy Group Inc   | 1 167 149            | 0,05              |
| 161 529 Wells Fargo & Co  | 6 037 954            | 0,27              |
| 2 766 West Pharmaceutical Services  | 958 336              | 0,04              |
| 12 526 Western Digital Corp   | 471 854              | 0,02              |
| 7 034 Westinghouse Air Brake Technologies Corp                            | 710 856              | 0,03              |
| 1 500 Westlake Corp   | 173 970              | 0,01              |
| 12 858 Westrock Co  | 391 783              | 0,02              |
| 2 990 Whirlpool Corp  | 394 740              | 0,02              |
| 50 460 Williams Cos Inc   | 1 506 736            | 0,07              |
| 5 204 Willis Towers Watson PLC  | 1 209 306            | 0,05              |
| 2 128 Wix.com Ltd   | 212 374              | 0,01              |
| 4 200 Wolfspeed Inc   | 272 790              | 0,01              |
| 8 334 Workday Inc   | 1 721 304            | 0,08              |
| 1 763 WW Grainger Inc   | 1 214 372            | 0,05              |
| 5 071 Wynn Resorts Ltd  | 567 496              | 0,03              |
| 20 919 Xcel Energy Inc  | 1 410 777            | 0,06              |
| 7 374 Xylem Inc/NY  | 772 058              | 0,03              |
| 12 139 Yum! Brands Inc  | 1 603 319            | 0,07              |
| 1 936 Zebra Technologies Corp   | 615 648              | 0,03              |
| 9 503 Zillow Group Inc  | 422 598              | 0,02              |
| 8 558 Zimmer Biomet Holdings Inc  | 1 105 694            | 0,05              |
| 19 226 Zoetis Inc   | 3 199 975            | 0,14              |
| 10 064 Zoom Video Communications Inc                                      | 743 126              | 0,03              |
| 7 400 ZoomInfo Technologies Inc   | 182 854              | 0,01              |
| 3 758 Zscaler Inc   | 439 047              | 0,02              |
|   | <b>1 479 557 331</b> | <b>66,01</b>      |
| <b>Total des actions ordinaires</b>                                       |                      |                   |
|   | <b>2 176 442 100</b> | <b>97,09</b>      |
| <b>Certificats représentatifs de titres – 0,11 % (mars 2022 : 0,12 %)</b> |                      |                   |
| <b>Dollar australien – 0,02 %</b>   |                      |                   |
| 21 526 James Hardie Industries PLC  | 458 895              | 0,02              |
|   | <b>458 895</b>       | <b>0,02</b>       |
| <b>Euro – 0,00 %</b>  |                      |                   |
| 3 197 ABN AMRO Bank NV  | 50 781               | 0,00              |
|   | <b>50 781</b>        | <b>0,00</b>       |
| <b>Dollar américain – 0,09 %</b>  |                      |                   |
| 1 700 Futu Holdings Ltd   | 88 145               | 0,01              |
| 14 816 Sea Ltd  | 1 282 325            | 0,06              |
| 55 463 Teva Pharmaceutical Industries Ltd                                 | 490 847              | 0,02              |
|   | <b>1 861 317</b>     | <b>0,09</b>       |
| <b>Total des certificats représentatifs de titres</b>                     |                      |                   |
|   | <b>2 370 993</b>     | <b>0,11</b>       |

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|--|------------------|-------------------|--|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b>                  |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %) (suite)</b>                          |                   |                   |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 2,08 % (mars 2022 : 2,28 %)</b> |                  |                   | <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 2,08 % (mars 2022 : 2,28 %) (suite)</b> |                   |                   |
| <b>Dollar australien – 0,11 %</b>  |                  |                   | <b>Dollar américain – 1,71 %</b>   |                   |                   |
| 68 652 Dexus   | 345 308          | 0,02              | 5 667 Alexandria Real Estate Equities Inc  | 711 719           | 0,03              |
| 74 438 Goodman Group   | 936 773          | 0,04              | 10 000 American Homes 4 Rent   | 314 500           | 0,01              |
| 46 533 GPT Group   | 132 142          | 0,01              | 19 298 American Tower Corp   | 3 943 353         | 0,18              |
| 236 357 Mirvac Group   | 329 264          | 0,01              | 17 212 Annaly Capital Management Inc   | 328 921           | 0,01              |
| 263 966 Scentre Group  | 486 176          | 0,02              | 5 468 AvalonBay Communities  | 918 952           | 0,04              |
| 127 558 Stockland  | 340 019          | 0,01              | 6 267 Boston Properties  | 339 170           | 0,02              |
| 29 152 Vicinity Ltd  | 37 975           | 0,00              | 4 305 Camden Property Trust  | 451 336           | 0,02              |
|  | <b>2 607 657</b> | <b>0,11</b>       | 17 994 Crown Castle Inc  | 2 408 317         | 0,11              |
| <b>Dollar canadien – 0,01 %</b>  |                  |                   | 11 995 Digital Realty Trust Inc  | 1 179 228         | 0,05              |
| 4 088 Canadian Apartment Properties REIT   | 143 209          | 0,01              | 3 937 Equinix Inc  | 2 838 734         | 0,13              |
| 1 462 RioCan Real Estate Investment Trust  | 22 027           | 0,00              | 8 278 Equity LifeStyle Properties Inc  | 555 702           | 0,02              |
|  | <b>165 236</b>   | <b>0,01</b>       | 15 081 Equity Residential  | 904 860           | 0,04              |
| <b>Euro – 0,06 %</b>   |                  |                   | 2 756 Essex Property Trust Inc   | 576 390           | 0,03              |
| 3 881 Covivio  | 226 005          | 0,01              | 6 170 Extra Space Storage Inc  | 1 005 278         | 0,04              |
| 1 302 Gecina SA  | 135 161          | 0,01              | 7 700 Gaming and Leisure Properties Inc  | 400 862           | 0,02              |
| 16 248 Klepierre SA  | 368 057          | 0,02              | 11 200 Healthcare Realty Trust Inc   | 216 496           | 0,01              |
| 6 131 Unibail-Rodamco-Westfield  | 328 955          | 0,01              | 20 980 Healthpeak Properties Inc   | 460 931           | 0,02              |
| 11 991 Warehouses De Pauw CVA  | 355 915          | 0,01              | 31 712 Host Hotels & Resorts Inc   | 522 931           | 0,02              |
|  | <b>1 414 093</b> | <b>0,06</b>       | 21 661 Invitation Homes Inc  | 676 473           | 0,03              |
| <b>Dollar de Hong Kong – 0,04 %</b>  |                  |                   | 14 340 Iron Mountain Inc   | 758 729           | 0,03              |
| 128 767 Link REIT  | 828 379          | 0,04              | 23 100 Kimco Realty Corp   | 451 143           | 0,02              |
|  | <b>828 379</b>   | <b>0,04</b>       | 22 874 Medical Properties Trust Inc  | 188 024           | 0,01              |
| <b>Yen japonais – 0,06 %</b>   |                  |                   | 4 543 Mid-America Apartment Communities Inc  | 686 175           | 0,03              |
| 47 Daiwa House REIT Investment Corp  | 95 879           | 0,00              | 38 101 Prologis Inc  | 4 753 862         | 0,21              |
| 311 GLP J-Reit   | 334 391          | 0,02              | 6 189 Public Storage   | 1 869 944         | 0,08              |
| 403 Japan Metropolitan Fund Invest   | 292 810          | 0,01              | 25 530 Realty Income   | 1 616 560         | 0,07              |
| 17 Japan Real Estate Investment Corp   | 67 443           | 0,00              | 9 116 Regency Centers Corp   | 557 717           | 0,03              |
| 54 Nippon Building Fund Inc  | 223 563          | 0,01              | 5 025 SBA Communications Corp  | 1 311 877         | 0,06              |
| 78 Nippon Prologis REIT Inc  | 164 275          | 0,01              | 12 699 Simon Property Group  | 1 421 907         | 0,06              |
| 117 Nomura Real Estate Master Fund Inc   | 130 547          | 0,01              | 4 879 Sun Communities Inc  | 687 354           | 0,03              |
|  | <b>1 308 908</b> | <b>0,06</b>       | 14 826 UDR Inc   | 608 756           | 0,03              |
| <b>Livre sterling – 0,04 %</b>   |                  |                   | 15 169 Ventas Inc  | 657 576           | 0,03              |
| 52 082 British Land Co PLC   | 249 731          | 0,01              | 38 092 VICI Properties Inc   | 1 242 561         | 0,06              |
| 8 637 Land Securities Group PLC  | 66 339           | 0,01              | 18 084 Welltower Inc   | 1 296 442         | 0,06              |
| 53 106 Segro PLC   | 504 029          | 0,02              | 30 613 Weyerhaeuser Co   | 922 370           | 0,04              |
|  | <b>820 099</b>   | <b>0,04</b>       | 8 541 WP Carey Inc   | 661 500           | 0,03              |
| <b>Dollar de Singapour – 0,05 %</b>  |                  |                   | <b>38 446 650</b>  | <b>1,71</b>       |                   |
| 223 665 CapitalLand Ascendas REIT  | 481 127          | 0,02              | <b>Total des fiducies de placement</b>   |                   |                   |
| 260 480 CapitalLand Integrated Commercial Trust                                    | 387 913          | 0,02              | <b>immobilier de type REIT</b>   | <b>46 738 036</b> | <b>2,08</b>       |
| 112 445 Mapletree Logistics Trust  | 144 621          | 0,01              |  |                   |                   |
| 98 500 Mapletree Pan Asia Commercial Trust   | 133 353          | 0,00              |  |                   |                   |
|  | <b>1 147 014</b> | <b>0,05</b>       |  |                   |                   |

## SPDR MSCI World UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD     | % des actifs nets |
|--|----------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,43 % (mars 2022 : 99,33 %)</b><br>(suite)                 |                      |                   |
| <b>Actions préférentielles – 0,15 % (mars 2022 : 0,13 %)</b><br><b>Euro – 0,15 %</b> |                      |                   |
| 431 Bayerische Motoren Werke AG (Non voting rights)                                  | 44 157               | 0,00              |
| 3 898 Dr. Ing. h.c. F.Porsche  | 499 728              | 0,02              |
| 9 750 Henkel AG & Co KGaA (Non voting rights)  | 763 323              | 0,03              |
| 6 702 Porsche Automobil Holding SE   | 385 331              | 0,02              |
| 1 496 Sartorius  | 629 002              | 0,03              |
| 7 368 Volkswagen AG (Non voting rights)  | 1 005 744            | 0,05              |
| <b>Total des actions préférentielles</b>   | <b>3 327 285</b>     | <b>0,15</b>       |
| <b>Droits – Néant (mars 2022 : 0,00 %)</b>   |                      |                   |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>  | <b>2 228 878 414</b> | <b>99,43</b>      |

Instruments financiers dérivés – 0,02 % (mars 2022 : 0,03 %)

Contrats à terme standardisés – 0,02 % (mars 2022 : 0,03 %)

| Montant notionnel | Prix du coût moyen |  | Plus-values/ (Moins-values) latentes USD | % des actifs nets |
|-------------------|--------------------|--|--|-------------------|
| 3 094 330         | 2 063              | 30 of MSCI EAFE Index Futures Long Futures Contracts Expiring 16 June 2023 | 50 420                                   | 0,00              |
| 7 161 660         | 3 979              | 36 of S&P 500 E-mini Index Futures Long Contracts Expiring 16 June 2023    | 286 290                                  | 0,02              |
| 357 727           | 894                | 2 of S&P/TSX 60 Index Futures Long Futures Expiring 15 June 2023           | (333)                                    | (0,00)            |
|                   |                    | <b>Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés</b>              | <b>336 710</b>                           | <b>0,02</b>       |
|                   |                    | <b>Moins-values latentes sur contrats à terme standardisés</b>             | <b>(333)</b>                             | <b>(0,00)</b>     |
|                   |                    | <b>Plus-values latentes nettes sur contrats à terme standardisés</b>       | <b>336 377</b>                           | <b>0,02</b>       |
|                   |                    | <b>Total des instruments financiers dérivés</b>                            | <b>336 377</b>                           | <b>0,02</b>       |

|   | Juste valeur USD     | % du Comp.    |
|---|----------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | 2 229 214 791        | 99,45         |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,47 %)</b>                               | 7 934 145            | 0,35          |
| <b>Liquidités détenues auprès d'un courtier* (mars 2022 : 0,01 %)</b>               | 482 240              | 0,02          |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : 0,16 %)</b>                                      | <u>3 938 093</u>     | <u>0,18</u>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>2 241 569 269</b> | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company, à l'exception des liquidités détenues auprès d'un courtier, en l'occurrence Barclays Capital.

Le courtier pour les contrats à terme standardisés ouverts est Barclays Capital.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

|   | % du total des actifs |
|---|-----------------------|
| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                        |                       |
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs | 99,42                 |
| Instruments financiers dérivés négociés en Bourse                       | 0,02                  |
| Autres actifs   | <u>0,56</u>           |
| <b>Total des actifs</b>   | <b>100,00</b>         |



## SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|--|-------|----------------------|----------------------|
| <b>Actifs circulants</b>   |       |                      |                      |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                         | 1(e)  |                      |                      |
| Valeurs mobilières   |       | 1 636 106 902        | 1 342 566 801        |
| Instruments financiers dérivés   |       | 23 760               | 53 815               |
|  |       | <b>1 636 130 662</b> | <b>1 342 620 616</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie  | 1(f)  | 750 191              | 688 612              |
| Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties à des instruments financiers ouverts | 1(g)  | 51 640               | -                    |
| Créances :   |       |                      |                      |
| Dividendes à recevoir  |       | 1 531 999            | 1 074 060            |
| <b>Total des actifs circulants</b>   |       | <b>1 638 464 492</b> | <b>1 344 383 288</b> |
| <b>Passifs circulants</b>  |       |                      |                      |
| Liquidités dues aux courtiers et aux contreparties pour des instruments financiers ouverts       | 1(g)  | -                    | (15 215)             |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :   |       |                      |                      |
| Charges à payer  |       | (414 735)            | (342 304)            |
| À payer sur achats d'investissements   |       | -                    | (245 253)            |
| <b>Total des passifs circulants</b>  |       | <b>(414 735)</b>     | <b>(602 772)</b>     |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>              |       | <b>1 638 049 757</b> | <b>1 343 780 516</b> |
|  |       | <b>2023</b>          | <b>2022</b>          |
|  |       | <b>2021</b>          |                      |
| Valeur liquidative par action  | 5     | 75,73 USD            | 80,32 USD            |
|  |       |                      | 77,22 USD            |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD         | 2022<br>USD       |
|--|-------|---------------------|-------------------|
| Produits de dividendes   |       | 22 668 444          | 18 065 086        |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat                 | 9     | (112 184 551)       | 29 107 131        |
| Produits divers  |       | 15 056              | 571               |
| <b>Total des (charges)/revenus d'investissement</b>  |       | <b>(89 501 051)</b> | <b>47 172 788</b> |
| Charges opérationnelles  | 3     | (3 759 660)         | (3 711 007)       |
| <b>(Perte)/Bénéfice net(te) pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(93 260 711)</b> | <b>43 461 781</b> |
| <b>Charges financières</b>   |       |                     |                   |
| Charges d'intérêts   |       | -                   | (4 052)           |
| <b>(Perte)/Bénéfice pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(93 260 711)</b> | <b>43 457 729</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement  | 2     | (3 913 988)         | (3 124 437)       |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(97 174 699)</b> | <b>40 333 292</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|--|----------------------|----------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier                              | 1 343 780 516        | 1 070 202 543        |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(97 174 699)</b>  | <b>40 333 292</b>    |
| <b>Opérations sur actions</b>  |                      |                      |
| Produits sur actions de participation rachetables émises   | 652 178 255          | 350 729 293          |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables   | (260 734 315)        | (117 484 612)        |
| Augmentation des actifs nets résultant d'opérations sur actions  | 391 443 940          | 233 244 681          |
| <b>Augmentation totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                                | <b>294 269 241</b>   | <b>273 577 973</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>                       | <b>1 638 049 757</b> | <b>1 343 780 516</b> |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|--|-------|----------------------|----------------------|
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(97 174 699)</b>  | <b>40 333 292</b>    |
| <b>Ajustement pour :</b>   |       |                      |                      |
| Variation de la trésorerie détenue par/à payer au courtier   |       | (66 855)             | 89 170               |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat   |       | (293 785 354)        | (273 086 397)        |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés  |       | 30 055               | (60 450)             |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>  |       | <b>(390 996 853)</b> | <b>(232 724 385)</b> |
| Variation des montants à recevoir  |       | (457 939)            | (360 678)            |
| Variation des montants à payer   |       | 72 431               | 75 679               |
| <b>Sorties de trésorerie sur opérations</b>  |       | <b>(385 508)</b>     | <b>(284 999)</b>     |
| <b>Sorties de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>   |       | <b>(391 382 361)</b> | <b>(233 009 384)</b> |
| <b>Activités de financement</b>  |       |                      |                      |
| Produits des souscriptions   | 5     | 652 178 255          | 350 729 293          |
| Paiements sur rachats  | 5     | (260 734 315)        | (117 484 612)        |
| <b>Trésorerie nette générée sur activités de financement</b>   |       | <b>391 443 940</b>   | <b>233 244 681</b>   |
| <b>Augmentation nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>  |       | <b>61 579</b>        | <b>235 297</b>       |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier   |       | 688 612              | 453 315              |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>  |       | <b>750 191</b>       | <b>688 612</b>       |
| <b>Informations supplémentaires</b>  |       |                      |                      |
| Impôts payés   |       | (3 913 988)          | (3 124 437)          |
| Intérêts payés   |       | -                    | (4 052)              |
| Dividendes reçus   |       | 22 210 505           | 17 704 408           |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                              | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,88 % (mars 2022 : 99,91 %)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 91,90 % (mars 2022 : 90,50 %)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 91,90 %</b>                         |                  |                   |
| 69 398 Acadia Healthcare Co Inc                           | 5 014 006        | 0,31              |
| 85 745 ACI Worldwide Inc                                  | 2 313 400        | 0,14              |
| 24 427 Acuity Brands Inc                                  | 4 463 546        | 0,27              |
| 72 883 Adient PLC   | 2 985 288        | 0,18              |
| 47 735 Advanced Drainage Systems Inc                      | 4 019 764        | 0,25              |
| 105 999 AECOM   | 8 937 836        | 0,55              |
| 28 714 Affiliated Managers Group Inc                      | 4 089 448        | 0,25              |
| 47 220 AGCO Corp  | 6 384 144        | 0,39              |
| 135 010 Alcoa Corp  | 5 746 026        | 0,35              |
| 49 683 Allegro MicroSystems Inc                           | 2 384 287        | 0,15              |
| 43 592 ALLETE Inc   | 2 806 017        | 0,17              |
| 24 748 Amedisys Inc                                       | 1 820 215        | 0,11              |
| 53 351 American Financial Group                           | 6 482 147        | 0,40              |
| 76 602 Amkor Technology Inc                               | 1 993 184        | 0,12              |
| 255 590 Antero Midstream Corp                             | 2 681 139        | 0,16              |
| 210 685 Antero Resources Corp                             | 4 864 717        | 0,30              |
| 49 854 AptarGroup Inc                                     | 5 892 244        | 0,36              |
| 198 768 Aramark   | 7 115 894        | 0,43              |
| 44 493 Arrow Electronics Inc                              | 5 555 841        | 0,34              |
| 81 485 Arrowhead Pharmaceuticals Inc                      | 2 069 719        | 0,13              |
| 38 099 ASGN Inc   | 3 149 644        | 0,19              |
| 38 116 Ashland Inc  | 3 914 894        | 0,24              |
| 22 190 Aspen Technology Inc                               | 5 078 625        | 0,31              |
| 114 691 Associated Banc-Corp                              | 2 062 144        | 0,13              |
| 59 224 Autoliv Inc  | 5 529 153        | 0,34              |
| 26 093 AutoNation Inc                                     | 3 505 855        | 0,21              |
| 65 225 Avient Corp  | 2 684 661        | 0,16              |
| 18 977 Avis Budget Group Inc                              | 3 696 720        | 0,23              |
| 69 705 Avnet Inc  | 3 150 666        | 0,19              |
| 168 365 Axalta Coating Systems Ltd                        | 5 099 776        | 0,31              |
| 51 571 Axon Enterprise Inc                                | 11 595 739       | 0,71              |
| 52 759 Azenta Inc   | 2 354 107        | 0,14              |
| 30 360 Bank of Hawaii Corp                                | 1 581 149        | 0,10              |
| 84 058 Bank OZK   | 2 874 784        | 0,18              |
| 32 623 Belden Inc   | 2 830 698        | 0,17              |
| 101 962 BellRing Brands Inc                               | 3 466 708        | 0,21              |
| 102 592 BJ's Wholesale Club Holdings Inc                  | 7 804 173        | 0,48              |
| 49 612 Black Hills Corp                                   | 3 130 517        | 0,19              |
| 34 033 Blackbaud Inc                                      | 2 358 487        | 0,14              |
| 7 149 Boston Beer Co Inc                                  | 2 349 876        | 0,14              |
| 60 525 Boyd Gaming Corp                                   | 3 880 863        | 0,24              |
| 52 083 Brighthouse Financial Inc                          | 2 297 381        | 0,14              |
| 35 411 Brink's Co   | 2 365 455        | 0,14              |
| 76 325 Bruker Corp  | 6 017 463        | 0,37              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,88 % (mars 2022 : 99,91 %)</b>         |                  |                   |
| <b>(suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 91,90 % (mars 2022 : 90,50 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 91,90 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 55 364 Brunswick Corp/DE  | 4 539 848        | 0,28              |
| 112 323 Builders FirstSource Inc                                  | 9 972 036        | 0,61              |
| 3 631 Cable One Inc   | 2 548 962        | 0,16              |
| 42 931 Cabot Corp   | 3 290 232        | 0,20              |
| 17 930 CACI International Inc                                     | 5 312 300        | 0,32              |
| 139 179 Cadence Bank  | 2 889 356        | 0,18              |
| 43 471 Calix Inc  | 2 329 611        | 0,14              |
| 95 936 Capri Holdings Ltd   | 4 508 992        | 0,28              |
| 39 430 Carlisle Cos Inc   | 8 913 940        | 0,54              |
| 29 099 Carter's Inc   | 2 092 800        | 0,13              |
| 28 409 Casey's General Stores Inc                                 | 6 149 412        | 0,38              |
| 55 500 Cathay General Bancorp                                     | 1 915 860        | 0,12              |
| 30 855 Celsius Holdings Inc                                       | 2 867 664        | 0,18              |
| 151 597 ChampionX Corp  | 4 112 827        | 0,25              |
| 32 200 Chart Industries Inc                                       | 4 037 880        | 0,25              |
| 11 364 Chemed Corp  | 6 110 991        | 0,37              |
| 113 147 Chemours Co   | 3 387 621        | 0,21              |
| 21 109 Choice Hotels International Inc                            | 2 473 764        | 0,15              |
| 31 791 Chord Energy Corp  | 4 279 069        | 0,26              |
| 25 086 Churchill Downs Inc  | 6 448 356        | 0,39              |
| 113 227 Ciena Corp  | 5 946 682        | 0,36              |
| 42 197 Cirrus Logic Inc   | 4 615 508        | 0,28              |
| 38 395 Clean Harbors Inc  | 5 473 591        | 0,33              |
| 393 144 Cleveland-Cliffs Inc                                      | 7 206 330        | 0,44              |
| 87 268 CNO Financial Group Inc                                    | 1 936 477        | 0,12              |
| 129 835 CNX Resources Corp  | 2 079 957        | 0,13              |
| 3 501 Coca-Cola Consolidated Inc                                  | 1 873 315        | 0,11              |
| 131 911 Cognex Corp   | 6 536 190        | 0,40              |
| 106 028 Coherent Corp   | 4 037 546        | 0,25              |
| 157 661 Columbia Banking System Inc                               | 3 377 099        | 0,21              |
| 27 038 Columbia Sportswear Co                                     | 2 439 909        | 0,15              |
| 86 795 Commerce Bancshares Inc/MO                                 | 5 064 488        | 0,31              |
| 89 339 Commercial Metals Co                                       | 4 368 677        | 0,27              |
| 34 004 CommVault Systems Inc                                      | 1 929 387        | 0,12              |
| 32 625 Concentrix Corp  | 3 965 569        | 0,24              |
| 279 709 Coty Inc  | 3 373 291        | 0,21              |
| 36 398 Crane Holdings Co  | 4 131 173        | 0,25              |
| 47 062 Crocs Inc  | 5 950 519        | 0,36              |
| 49 064 Cullen/Frost Bankers Inc                                   | 5 168 402        | 0,32              |
| 29 180 Curtiss-Wright Corp  | 5 143 267        | 0,31              |
| 97 387 Dana Inc   | 1 465 674        | 0,09              |
| 122 291 Darling Ingredients                                       | 7 141 794        | 0,44              |
| 20 078 Deckers Outdoor Corp                                       | 9 026 065        | 0,55              |

## SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,88 % (mars 2022 : 99,91 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 91,90 % (mars 2022 : 90,50 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 91,90 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 45 679 Dick's Sporting Goods Inc                                  | 6 481 393        | 0,40              |
| 92 890 Donaldson Co Inc   | 6 069 433        | 0,37              |
| 73 842 DT Midstream Inc   | 3 645 580        | 0,22              |
| 165 394 Dynatrace Inc   | 6 996 166        | 0,43              |
| 27 490 Eagle Materials Inc  | 4 034 158        | 0,25              |
| 107 502 East West Bancorp Inc                                     | 5 966 361        | 0,36              |
| 36 388 EMCOR Group Inc  | 5 916 325        | 0,36              |
| 76 176 Encompass Health Corp                                      | 4 121 122        | 0,25              |
| 51 006 Energizer Holdings Inc                                     | 1 769 908        | 0,11              |
| 31 121 EnerSys  | 2 703 792        | 0,16              |
| 36 356 Enovis Corp  | 1 944 682        | 0,12              |
| 42 241 Envestnet Inc  | 2 478 279        | 0,15              |
| 124 548 Envista Holdings Corp                                     | 5 091 522        | 0,31              |
| 330 179 Equitrans Midstream Corp                                  | 1 908 435        | 0,12              |
| 39 443 Esab Corp  | 2 329 898        | 0,14              |
| 82 134 Essent Group Ltd   | 3 289 467        | 0,20              |
| 182 125 Essential Utilities Inc                                   | 7 949 756        | 0,49              |
| 35 972 Euronet Worldwide Inc                                      | 4 025 267        | 0,25              |
| 27 273 Evercore Inc   | 3 146 759        | 0,19              |
| 247 257 Exelixis Inc  | 4 799 258        | 0,29              |
| 25 230 ExtService Holdings Inc                                    | 4 082 971        | 0,25              |
| 38 550 Exponent Inc   | 3 843 050        | 0,23              |
| 64 532 Federated Hermes Inc                                       | 2 590 314        | 0,16              |
| 79 009 First American Financial Corp                              | 4 397 641        | 0,27              |
| 99 080 First Financial Bankshares Inc                             | 3 160 652        | 0,19              |
| 409 450 First Horizon Corp  | 7 280 021        | 0,44              |
| 28 656 FirstCash Holdings Inc                                     | 2 732 923        | 0,17              |
| 42 379 Five Below Inc   | 8 728 803        | 0,53              |
| 146 607 Flowers Foods Inc   | 4 018 498        | 0,25              |
| 99 767 Flowserve Corp   | 3 392 078        | 0,21              |
| 108 436 Fluor Corp  | 3 351 757        | 0,20              |
| 275 022 FNB Corp/PA   | 3 190 255        | 0,19              |
| 60 510 Foot Locker Inc  | 2 401 642        | 0,15              |
| 97 842 Fortune Brands Innovations Inc                             | 5 746 261        | 0,35              |
| 32 277 Fox Factory Holding Corp                                   | 3 917 459        | 0,24              |
| 170 076 Frontier Communications Parent Inc                        | 3 872 631        | 0,24              |
| 26 240 FTI Consulting Inc   | 5 178 464        | 0,32              |
| 127 873 Fulton Financial Corp                                     | 1 767 205        | 0,11              |
| 192 860 GameStop Corp   | 4 439 637        | 0,27              |
| 162 386 Gap Inc   | 1 630 355        | 0,10              |
| 26 851 GATX Corp  | 2 954 147        | 0,18              |
| 128 385 Genpact Ltd   | 5 933 955        | 0,36              |
| 178 943 Gentex Corp   | 5 015 772        | 0,31              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,88 % (mars 2022 : 99,91 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 91,90 % (mars 2022 : 90,50 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 91,90 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 84 502 Glacier Bancorp Inc  | 3 549 929        | 0,22              |
| 59 572 Globus Medical Inc   | 3 374 158        | 0,21              |
| 215 874 Goodyear Tire & Rubber Co                                 | 2 378 931        | 0,15              |
| 128 590 Graco Inc   | 9 388 356        | 0,57              |
| 2 884 Graham Holdings Co  | 1 718 403        | 0,10              |
| 23 409 Grand Canyon Education Inc                                 | 2 666 285        | 0,16              |
| 19 438 Greif  | 1 231 786        | 0,08              |
| 67 572 Grocery Outlet Holding Corp                                | 1 909 585        | 0,12              |
| 90 502 GXO Logistics Inc  | 4 566 731        | 0,28              |
| 116 197 H&R Block Inc   | 4 095 944        | 0,25              |
| 38 466 Haemonetics Corp   | 3 183 062        | 0,19              |
| 103 181 Halozyne Therapeutics Inc                                 | 3 940 482        | 0,24              |
| 65 389 Hancock Whitney Corp                                       | 2 380 160        | 0,15              |
| 27 173 Hanover Insurance Group Inc                                | 3 491 731        | 0,21              |
| 101 540 Harley-Davidson Inc                                       | 3 855 474        | 0,24              |
| 83 504 Hawaiian Electric Industries Inc                           | 3 206 554        | 0,20              |
| 64 606 HealthEquity Inc   | 3 793 018        | 0,23              |
| 18 252 Helen of Troy Ltd  | 1 737 043        | 0,11              |
| 123 006 Hertz Global Holdings Inc                                 | 2 003 768        | 0,12              |
| 64 309 Hexcel Corp  | 4 389 089        | 0,27              |
| 102 598 HF Sinclair Corp  | 4 963 691        | 0,30              |
| 60 612 Hilton Grand Vacations Inc                                 | 2 692 991        | 0,16              |
| 144 343 Home BancShares Inc/AR                                    | 3 133 687        | 0,19              |
| 40 918 Hubbell Inc  | 9 955 759        | 0,61              |
| 15 332 ICU Medical Inc  | 2 529 167        | 0,15              |
| 38 583 IDACORP Inc  | 4 179 696        | 0,26              |
| 36 795 Inari Medical Inc  | 2 271 723        | 0,14              |
| 26 778 Ingevity Corp  | 1 915 163        | 0,12              |
| 50 168 Ingredion Inc  | 5 103 591        | 0,31              |
| 27 168 Insperty Inc   | 3 302 270        | 0,20              |
| 55 415 Integra LifeSciences Holdings Corp                         | 3 181 375        | 0,19              |
| 78 454 Interactive Brokers Group Inc                              | 6 477 162        | 0,40              |
| 40 251 International Bancshares Corp                              | 1 723 548        | 0,11              |
| 24 506 IPG Photonics Corp   | 3 021 835        | 0,18              |
| 95 868 Iridium Communications Inc                                 | 5 937 105        | 0,36              |
| 63 101 ITT Inc  | 5 445 616        | 0,33              |
| 101 707 Jabil Inc   | 8 966 489        | 0,55              |
| 101 162 Janus Henderson Group PLC                                 | 2 694 956        | 0,16              |
| 48 013 Jazz Pharmaceuticals PLC                                   | 7 025 742        | 0,43              |
| 138 038 Jefferies Financial Group Inc                             | 4 381 326        | 0,27              |
| 247 106 JetBlue Airways Corp                                      | 1 798 932        | 0,11              |
| 32 687 John Wiley & Sons Inc                                      | 1 267 275        | 0,08              |
| 36 239 Jones Lang LaSalle Inc                                     | 5 272 412        | 0,32              |

## SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,88 % (mars 2022 : 99,91 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,88 % (mars 2022 : 99,91 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 91,90 % (mars 2022 : 90,50 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 91,90 % (mars 2022 : 90,50 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 91,90 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 91,90 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 62 299 KB Home  | 2 503 174        | 0,15              | 70 027 National Fuel Gas Co                                       | 4 043 359        | 0,25              |
| 104 698 KBR Inc   | 5 763 625        | 0,35              | 99 585 National Instruments Corp                                  | 5 219 250        | 0,32              |
| 48 754 Kemper Corp  | 2 664 894        | 0,16              | 77 389 Navient Corp   | 1 237 450        | 0,08              |
| 16 586 Kinsale Capital Group Inc                                  | 4 978 288        | 0,30              | 105 657 NCR Corp  | 2 492 449        | 0,15              |
| 45 714 Kirby Corp   | 3 186 266        | 0,19              | 164 909 Neogen Corp   | 3 054 115        | 0,19              |
| 122 606 Knight-Swift Transportation Holdings Inc                  | 6 937 047        | 0,42              | 73 655 Neurocrine Biosciences                                     | 7 455 359        | 0,46              |
| 84 300 Kohl's Corp  | 1 984 422        | 0,12              | 74 030 New Jersey Resources Corp                                  | 3 938 396        | 0,24              |
| 156 984 Kyndryl Holdings Inc                                      | 2 317 084        | 0,14              | 519 735 New York Community Bancorp Inc                            | 4 698 404        | 0,29              |
| 15 190 Lancaster Colony Corp                                      | 3 081 747        | 0,19              | 125 627 New York Times Co   | 4 884 378        | 0,30              |
| 27 412 Landstar System Inc  | 4 913 875        | 0,30              | 5 138 NewMarket Corp  | 1 875 267        | 0,11              |
| 52 521 Lantheus Holdings Inc                                      | 4 336 134        | 0,26              | 28 821 Nexstar Media Group Inc                                    | 4 976 234        | 0,30              |
| 104 623 Lattice Semiconductor Corp                                | 9 991 497        | 0,61              | 85 519 Nordstrom Inc  | 1 391 394        | 0,08              |
| 45 164 Lear Corp  | 6 299 926        | 0,38              | 44 131 NorthWestern Corp  | 2 553 420        | 0,16              |
| 101 207 Leggett & Platt Inc                                       | 3 226 479        | 0,20              | 299 727 NOV Inc   | 5 547 947        | 0,34              |
| 24 655 Lennox International Inc                                   | 6 195 308        | 0,38              | 27 282 Novanta Inc  | 4 340 293        | 0,26              |
| 71 441 Light & Wonder Inc   | 4 290 032        | 0,26              | 127 057 nVent Electric PLC  | 5 455 828        | 0,33              |
| 44 021 Lincoln Electric Holdings Inc                              | 7 443 951        | 0,45              | 152 803 OGE Energy Corp   | 5 754 561        | 0,35              |
| 20 811 Lithia Motors Inc  | 4 764 262        | 0,29              | 223 443 Old National Bancorp/IN                                   | 3 222 048        | 0,20              |
| 18 837 Littelfuse Inc   | 5 050 011        | 0,31              | 210 422 Old Republic International Corp                           | 5 254 237        | 0,32              |
| 40 770 LivaNova PLC   | 1 776 757        | 0,11              | 93 835 Olin Corp  | 5 207 843        | 0,32              |
| 54 751 Louisiana-Pacific Corp                                     | 2 968 052        | 0,18              | 44 192 Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc                        | 2 560 484        | 0,16              |
| 52 202 Lumentum Holdings Inc                                      | 2 819 430        | 0,17              | 34 002 Omnicell Inc   | 1 994 897        | 0,12              |
| 39 285 MACOM Technology Solutions Holdings Inc                    | 2 782 949        | 0,17              | 41 343 ONE Gas Inc  | 3 275 606        | 0,20              |
| 206 893 Macy's Inc  | 3 618 559        | 0,22              | 127 664 Option Care Health Inc                                    | 4 055 885        | 0,25              |
| 47 689 Manhattan Associates Inc                                   | 7 384 642        | 0,45              | 40 011 Ormat Technologies Inc                                     | 3 391 732        | 0,21              |
| 38 623 ManpowerGroup Inc  | 3 187 556        | 0,19              | 49 944 Oshkosh Corp   | 4 154 342        | 0,25              |
| 29 231 Marriott Vacations Worldwide Corp                          | 3 942 093        | 0,24              | 71 302 Owens Corning  | 6 830 732        | 0,42              |
| 36 855 Masimo Corp  | 6 801 222        | 0,42              | 90 644 PacWest Bancorp  | 881 966          | 0,05              |
| 45 185 MasTec Inc   | 4 267 271        | 0,26              | 24 514 Papa John's International Inc                              | 1 836 834        | 0,11              |
| 85 608 Matador Resources Co                                       | 4 079 221        | 0,25              | 65 882 Patterson Cos Inc  | 1 763 661        | 0,11              |
| 270 402 Mattel Inc  | 4 978 101        | 0,30              | 31 499 Paylocity Holding Corp                                     | 6 261 371        | 0,38              |
| 46 336 Maximus Inc  | 3 646 643        | 0,22              | 87 202 PBF Energy Inc   | 3 781 079        | 0,23              |
| 155 169 MDU Resources Group Inc                                   | 4 729 551        | 0,29              | 70 329 PDC Energy Inc   | 4 513 715        | 0,28              |
| 19 173 Medpace Holdings Inc                                       | 3 605 483        | 0,22              | 118 355 Penn Entertainment Inc                                    | 3 510 409        | 0,21              |
| 44 286 Mercury Systems Inc  | 2 263 900        | 0,14              | 28 987 Penumbra Inc   | 8 078 387        | 0,49              |
| 223 892 MGIC Investment Corp                                      | 3 004 631        | 0,18              | 119 151 Performance Food Group Co                                 | 7 189 571        | 0,44              |
| 41 162 Middleby Corp  | 6 034 761        | 0,37              | 102 682 Perrigo Co PLC  | 3 683 203        | 0,22              |
| 43 624 MKS Instruments Inc  | 3 865 959        | 0,24              | 34 529 Pilgrim's Pride Corp                                       | 800 382          | 0,05              |
| 70 469 MP Materials Corp  | 1 986 521        | 0,12              | 58 390 Pinnacle Financial Partners Inc                            | 3 220 792        | 0,20              |
| 28 102 MSA Safety Inc   | 3 751 617        | 0,23              | 65 513 PNM Resources Inc  | 3 189 173        | 0,19              |
| 36 134 MSC Industrial Direct Co Inc                               | 3 035 256        | 0,19              | 41 618 Polaris Inc  | 4 604 199        | 0,28              |
| 111 473 Murphy Oil Corp   | 4 122 272        | 0,25              | 68 085 Portland General Electric Co                               | 3 328 676        | 0,20              |
| 15 218 Murphy USA Inc   | 3 927 005        | 0,24              | 40 927 Post Holdings Inc  | 3 678 109        | 0,22              |

## SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,88 % (mars 2022 : 99,91 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 91,90 % (mars 2022 : 90,50 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 91,90 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 43 463 Power Integrations Inc                                     | 3 678 708        | 0,22              |
| 28 168 Primerica Inc  | 4 851 656        | 0,30              |
| 57 355 Progyny Inc  | 1 842 243        | 0,11              |
| 69 683 Prosperity Bancshares Inc                                  | 4 286 898        | 0,26              |
| 48 377 PVH Corp   | 4 313 293        | 0,26              |
| 26 398 Qualys Inc   | 3 432 268        | 0,21              |
| 40 806 QuidelOrtho Corp   | 3 635 407        | 0,22              |
| 104 860 R1 RCM Inc  | 1 572 900        | 0,10              |
| 184 392 Range Resources Corp                                      | 4 880 856        | 0,30              |
| 50 486 Regal Rexnord Corp   | 7 104 895        | 0,43              |
| 50 913 Reinsurance Group of America Inc                           | 6 759 210        | 0,41              |
| 44 756 Reliance Steel & Aluminum Co                               | 11 490 655       | 0,70              |
| 33 377 RenaissanceRe Holdings Ltd                                 | 6 686 748        | 0,41              |
| 39 368 Repligen Corp  | 6 627 996        | 0,40              |
| 14 237 RH   | 3 467 421        | 0,21              |
| 1 Ritchie Bros Auctioneers Inc                                    | 56               | 0,00              |
| 30 911 RLI Corp   | 4 108 381        | 0,25              |
| 50 054 Royal Gold Inc   | 6 492 504        | 0,40              |
| 98 465 RPM International Inc                                      | 8 590 087        | 0,52              |
| 38 346 Ryder System Inc   | 3 421 997        | 0,21              |
| 20 151 Saia Inc   | 5 482 684        | 0,33              |
| 41 712 Science Applications International Corp                    | 4 482 372        | 0,27              |
| 31 154 Scotts Miracle-Gro Co                                      | 2 172 680        | 0,13              |
| 77 824 SEI Investments Co   | 4 478 771        | 0,27              |
| 46 030 Selective Insurance Group Inc                              | 4 388 040        | 0,27              |
| 32 056 Sensient Technologies Corp                                 | 2 454 207        | 0,15              |
| 117 384 Service Corp International/US                             | 8 073 672        | 0,49              |
| 27 624 Shockwave Medical Inc                                      | 5 989 712        | 0,37              |
| 63 791 Silgan Holdings Inc  | 3 423 663        | 0,21              |
| 24 332 Silicon Laboratories Inc                                   | 4 260 290        | 0,26              |
| 32 503 Simpson Manufacturing Co Inc                               | 3 563 629        | 0,22              |
| 12 279 STime Corp   | 1 746 442        | 0,11              |
| 102 417 Skechers USA Inc  | 4 866 856        | 0,30              |
| 183 616 SLM Corp  | 2 275 002        | 0,14              |
| 74 442 Sonoco Products Co   | 4 540 962        | 0,28              |
| 75 342 Sotera Health Co   | 1 349 375        | 0,08              |
| 57 739 SouthState Corp  | 4 114 481        | 0,25              |
| 49 584 Southwest Gas Holdings Inc                                 | 3 096 521        | 0,19              |
| 842 035 Southwestern Energy Co                                    | 4 210 175        | 0,26              |
| 40 110 Spire Inc  | 2 813 315        | 0,17              |
| 80 814 Sprouts Farmers Market Inc                                 | 2 830 914        | 0,17              |
| 36 772 STAAR Surgical Co  | 2 351 569        | 0,14              |
| 70 310 Stericycle Inc   | 3 066 219        | 0,19              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,88 % (mars 2022 : 99,91 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 91,90 % (mars 2022 : 90,50 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 91,90 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 80 378 Stifel Financial Corp                                      | 4 749 536        | 0,29              |
| 65 867 SunPower Corp  | 911 599          | 0,06              |
| 162 634 Sunrun Inc  | 3 277 075        | 0,20              |
| 35 365 Super Micro Computer Inc                                   | 3 768 141        | 0,23              |
| 30 039 Synaptics Inc  | 3 338 835        | 0,20              |
| 78 496 Syneos Health Inc  | 2 796 028        | 0,17              |
| 111 017 Synovus Financial Corp                                    | 3 422 654        | 0,21              |
| 82 704 Taylor Morrison Home Corp                                  | 3 164 255        | 0,19              |
| 31 976 TD SYNEX Corp  | 3 094 957        | 0,19              |
| 170 214 TEGNA Inc   | 2 878 319        | 0,18              |
| 129 980 Tempur Sealy International Inc                            | 5 132 910        | 0,31              |
| 82 540 Tenet Healthcare Corp                                      | 4 904 527        | 0,30              |
| 77 661 Teradata Corp  | 3 128 185        | 0,19              |
| 51 501 Terex Corp   | 2 491 618        | 0,15              |
| 40 588 Tetra Tech Inc   | 5 962 783        | 0,36              |
| 36 822 Texas Capital Bancshares Inc                               | 1 802 805        | 0,11              |
| 51 014 Texas Roadhouse Inc  | 5 512 573        | 0,34              |
| 40 878 Thor Industries Inc  | 3 255 524        | 0,20              |
| 50 536 Timken Co  | 4 129 802        | 0,25              |
| 78 415 Toll Brothers Inc  | 4 707 252        | 0,29              |
| 24 397 TopBuild Corp  | 5 077 992        | 0,31              |
| 105 815 Topgolf Callaway Brands Corp                              | 2 287 720        | 0,14              |
| 79 856 Toro Co  | 8 876 793        | 0,54              |
| 62 061 Travel + Leisure Co  | 2 432 791        | 0,15              |
| 83 779 Trex Co Inc  | 4 077 524        | 0,25              |
| 79 737 TripAdvisor Inc  | 1 583 577        | 0,10              |
| 47 024 UFP Industries Inc   | 3 736 997        | 0,23              |
| 159 880 UGI Corp  | 5 557 429        | 0,34              |
| 33 173 UMB Financial Corp   | 1 914 746        | 0,12              |
| 143 634 Under Armour Inc (Class A)                                | 1 363 087        | 0,08              |
| 144 598 Under Armour Inc (Class C)                                | 1 233 421        | 0,08              |
| 102 486 United Bankshares Inc/WV                                  | 3 607 507        | 0,22              |
| 172 911 United States Steel Corp                                  | 4 512 977        | 0,28              |
| 34 791 United Therapeutics Corp                                   | 7 791 792        | 0,48              |
| 124 461 Univar Solutions Inc                                      | 4 359 869        | 0,27              |
| 33 135 Universal Display Corp                                     | 5 140 233        | 0,31              |
| 142 694 Unum Group  | 5 644 975        | 0,34              |
| 156 182 US Foods Holding Corp                                     | 5 769 363        | 0,35              |
| 45 853 Valaris Ltd  | 2 983 196        | 0,18              |
| 320 684 Valley National Bancorp                                   | 2 963 120        | 0,18              |
| 16 246 Valmont Industries Inc                                     | 5 187 023        | 0,32              |
| 131 211 Valvoline Inc   | 4 584 512        | 0,28              |
| 17 189 Vicor Corp   | 806 852          | 0,05              |



## SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD     | % des actifs nets |
|--|----------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,88 % (mars 2022 : 99,91 %) (suite)</b>                  |                      |                   |
| <b>Actions ordinaires – 91,90 % (mars 2022 : 90,50 %) (suite)</b>                  |                      |                   |
| <b>Dollar américain – 91,90 % (suite)</b>  |                      |                   |
| 61 631 Victoria's Secret & Co  | 2 104 699            | 0,13              |
| 98 882 Vishay Intertechnology Inc  | 2 236 711            | 0,14              |
| 21 474 Visteon Corp  | 3 367 767            | 0,21              |
| 120 563 Vontier Corp   | 3 296 192            | 0,20              |
| 73 997 Voya Financial Inc  | 5 287 826            | 0,32              |
| 25 375 Watsco Inc  | 8 073 310            | 0,49              |
| 20 861 Watts Water Technologies Inc  | 3 511 324            | 0,21              |
| 132 812 Webster Financial Corp   | 5 235 449            | 0,32              |
| 130 031 Wendy's Co   | 2 832 075            | 0,17              |
| 44 835 Werner Enterprises Inc  | 2 039 544            | 0,12              |
| 285 001 Western Union Co   | 3 177 761            | 0,19              |
| 26 294 Westlake Corp   | 3 049 578            | 0,19              |
| 33 251 WEX Inc   | 6 114 526            | 0,37              |
| 50 749 Williams-Sonoma Inc   | 6 174 123            | 0,38              |
| 22 811 Wingstop Inc  | 4 187 643            | 0,26              |
| 46 410 Wintrust Financial Corp   | 3 385 610            | 0,21              |
| 94 957 Wolfspeed Inc   | 6 167 457            | 0,38              |
| 45 536 Woodward Inc  | 4 433 840            | 0,27              |
| 33 076 World Wrestling Entertainment Inc   | 3 018 516            | 0,18              |
| 23 111 Worthington Industries Inc  | 1 494 126            | 0,09              |
| 67 368 Wyndham Hotels & Resorts Inc  | 4 570 919            | 0,28              |
| 85 330 Xerox Holdings Corp   | 1 314 082            | 0,08              |
| 87 764 XPO Inc   | 2 799 672            | 0,17              |
| 65 787 YETI Holdings Inc   | 2 631 480            | 0,16              |
| 35 997 Ziff Davis Inc  | 2 809 566            | 0,17              |
| <b>Total des actions ordinaires</b>  | <b>1 505 434 194</b> | <b>91,90</b>      |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 7,98 % (mars 2022 : 9,41 %)</b> |                      |                   |
| <b>Dollar américain – 7,98 %</b>   |                      |                   |
| 67 584 Agree Realty Corp   | 4 636 938            | 0,28              |
| 357 335 Annaly Capital Management Inc  | 6 828 672            | 0,42              |
| 113 459 Apartment Income REIT Corp   | 4 062 967            | 0,25              |
| 228 806 Brixmor Property Group Inc   | 4 923 905            | 0,30              |
| 85 772 Corporate Office Properties Trust   | 2 033 654            | 0,12              |
| 115 646 Cousins Properties Inc   | 2 472 511            | 0,15              |
| 171 310 CubeSmart  | 7 917 948            | 0,48              |
| 133 868 Douglas Emmett Inc   | 1 650 592            | 0,10              |
| 33 249 EastGroup Properties Inc  | 5 496 725            | 0,34              |
| 57 272 EPR Properties  | 2 182 063            | 0,13              |
| 100 783 First Industrial Realty Trust Inc  | 5 361 656            | 0,33              |
| 290 388 Healthcare Realty Trust Inc  | 5 613 200            | 0,34              |
| 80 321 Highwoods Properties Inc  | 1 862 644            | 0,11              |
| 170 774 Independence Realty Trust Inc  | 2 737 507            | 0,17              |
| 80 447 Kilroy Realty Corp  | 2 606 483            | 0,16              |

| Participation Investissement   | Juste valeur USD     | % des actifs nets |
|--|----------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,88 % (mars 2022 : 99,91 %) (suite)</b>                          |                      |                   |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 7,98 % (mars 2022 : 9,41 %) (suite)</b> |                      |                   |
| <b>Dollar américain – 7,98 % (suite)</b>   |                      |                   |
| 167 198 Kite Realty Group Trust  | 3 497 782            | 0,21              |
| 66 559 Lamar Advertising Co  | 6 648 579            | 0,41              |
| 64 818 Life Storage Inc  | 8 496 992            | 0,52              |
| 165 286 Macerich Co  | 1 752 032            | 0,11              |
| 457 000 Medical Properties Trust Inc   | 3 756 540            | 0,23              |
| 137 534 National Retail Properties Inc   | 6 072 126            | 0,37              |
| 64 519 National Storage Affiliates Trust   | 2 695 604            | 0,16              |
| 178 753 Omega Healthcare Investors Inc   | 4 899 620            | 0,30              |
| 171 551 Park Hotels & Resorts Inc  | 2 120 370            | 0,13              |
| 174 196 Physicians Realty Trust  | 2 600 746            | 0,16              |
| 61 606 PotlatchDeltic Corp   | 3 049 497            | 0,19              |
| 112 620 Rayonier Inc   | 3 745 741            | 0,23              |
| 144 320 Rexford Industrial Realty Inc  | 8 608 688            | 0,53              |
| 176 193 Sabra Health Care REIT Inc   | 2 026 220            | 0,12              |
| 106 573 Spirit Realty Capital Inc  | 4 245 868            | 0,26              |
| 236 205 Starwood Property Trust Inc  | 4 178 466            | 0,25              |
| 122 991 Vornado Realty Trust   | 1 890 372            | 0,12              |
| <b>Total des fiducies de placement immobilier de type REIT</b>                             | <b>130 672 708</b>   | <b>7,98</b>       |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>  | <b>1 636 106 902</b> | <b>99,88</b>      |

**Instruments financiers dérivés – 0,00 % (mars 2022 : 0,00 %)**

**Contrats à terme standardisés – 0,00 % (mars 2022 : 0,00 %)**

| Montant notionnel | Prix du coût moyen | Plus-values latentes USD   | % des actifs nets |
|-------------------|--------------------|--|-------------------|
| 988 120           | 2 470              | 4 of S&P Mid 400 E-mini Index Futures Long Futures Contracts Expiring 16 June 2023 | 0,00              |
|                   |                    | <b>Plus-values latentes nettes sur contrats à terme standardisés</b>               | <b>0,00</b>       |
|                   |                    | <b>Total des instruments financiers dérivés</b>                                    | <b>0,00</b>       |

## SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

|   | Juste valeur<br>USD             | % du<br>Comp.            |
|---|---------------------------------|--------------------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | 1 636 130 662                   | 99,88                    |
| <b>Disponibilités bancaires*</b><br>(mars 2022 : 0,05 %)                                    | 750 191                         | 0,05                     |
| <b>Liquidités détenues auprès d'un<br/>courtier* (mars 2022 : néant)</b>                    | 51 640                          | 0,00                     |
| <b>Montants à recevoir du courtier</b><br>(mars 2022 : (0,00 %))                            | -                               | -                        |
| <b>Autres actifs nets</b><br>(mars 2022 : 0,04 %)   | <u>1 117 264</u>                | <u>0,07</u>              |
| <br><b>Actifs nets attribuables aux porteurs<br/>d'actions de participation rachetables</b> | <br><u><b>1 638 049 757</b></u> | <br><u><b>100,00</b></u> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company, à l'exception des liquidités détenues auprès d'un courtier, en l'occurrence Goldman Sachs.

Le courtier pour les contrats à terme standardisés ouverts est Goldman Sachs.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

|   | % du<br>total<br>des actifs |
|---|-----------------------------|
| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                        |                             |
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs | 99,86                       |
| Instruments financiers dérivés négociés en Bourse                       | 0,00                        |
| Autres actifs   | <u>0,14</u>                 |
| <b>Total des actifs</b>   | <u><b>100,00</b></u>        |

## SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF\*

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD        | 2022<br>USD        |             |
|--|-------|--------------------|--------------------|-------------|
| <b>Actifs circulants</b>   |       |                    |                    |             |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                         | 1(e)  |                    |                    |             |
| Valeurs mobilières   |       | 748 655 366        | 570 653 933        |             |
| Instruments financiers dérivés   |       | 92 680             | 82 850             |             |
|  |       | <b>748 748 046</b> | <b>570 736 783</b> |             |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie  | 1(f)  | 2 132 180          | 1 278 207          |             |
| Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties à des instruments financiers ouverts | 1(g)  | 24 760             | -                  |             |
| Créances :   |       |                    |                    |             |
| Dividendes à recevoir  |       | 419 873            | 263 312            |             |
| <b>Total des actifs circulants</b>   |       | <b>751 324 859</b> | <b>572 278 302</b> |             |
| <b>Passifs circulants</b>  |       |                    |                    |             |
| Liquidités dues aux courtiers et aux contreparties pour des instruments financiers ouverts       | 1(g)  | -                  | (37 200)           |             |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :   |       |                    |                    |             |
| Charges à payer  |       | (62 902)           | (44 770)           |             |
| <b>Total des passifs circulants</b>  |       | <b>(62 902)</b>    | <b>(81 970)</b>    |             |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>              |       | <b>751 261 957</b> | <b>572 196 332</b> |             |
|  |       | <b>2023*</b>       | <b>2022</b>        | <b>2021</b> |
| Valeur liquidative par action  | 5     | 28,24 USD          | 30,12 USD          | 26,08 USD   |

\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF\*

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD         | 2022<br>USD       |
|--|-------|---------------------|-------------------|
| Produits de dividendes   |       | 11 483 889          | 6 837 409         |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat                 | 9     | (28 617 549)        | 56 133 956        |
| Produits divers  |       | 21 059              | 642               |
| <b>Total des (charges)/revenus d'investissement</b>  |       | <b>(17 112 601)</b> | <b>62 972 007</b> |
| Charges opérationnelles  | 3     | (666 318)           | (499 540)         |
| <b>(Perte)/Bénéfice net(te) pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(17 778 919)</b> | <b>62 472 467</b> |
| <b>Charges financières</b>   |       |                     |                   |
| Charges d'intérêts   |       | -                   | (808)             |
| <b>(Perte)/Bénéfice pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(17 778 919)</b> | <b>62 471 659</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement  | 2     | (1 728 564)         | (1 023 780)       |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(19 507 483)</b> | <b>61 447 879</b> |

\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF\*

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | 2023<br>USD         | 2022<br>USD        |
|--|---------------------|--------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier                              | 572 196 332         | 349 508 280        |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(19 507 483)</b> | <b>61 447 879</b>  |
| <b>Opérations sur actions</b>  |                     |                    |
| Produits sur actions de participation rachetables émises   | 317 272 009         | 266 831 895        |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables   | (118 698 901)       | (105 591 722)      |
| Augmentation des actifs nets résultant d'opérations sur actions  | 198 573 108         | 161 240 173        |
| <b>Augmentation totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                                | <b>179 065 625</b>  | <b>222 688 052</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>                       | <b>751 261 957</b>  | <b>572 196 332</b> |

\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF\*

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|--|-------|----------------------|----------------------|
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(19 507 483)</b>  | <b>61 447 879</b>    |
| <b>Ajustement pour :</b>   |       |                      |                      |
| Variation de la trésorerie détenue par/à payer au courtier   |       | (61 960)             | 64 890               |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat   |       | (178 001 433)        | (221 952 895)        |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés  |       | (9 830)              | (80 150)             |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>  |       | <b>(197 580 706)</b> | <b>(160 520 276)</b> |
| Variation des montants à recevoir  |       | (156 561)            | (86 733)             |
| Variation des montants à payer   |       | 18 132               | 15 696               |
| <b>Sorties de trésorerie sur opérations</b>  |       | <b>(138 429)</b>     | <b>(71 037)</b>      |
| <b>Sorties de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>   |       | <b>(197 719 135)</b> | <b>(160 591 313)</b> |
| <b>Activités de financement</b>  |       |                      |                      |
| Produits des souscriptions   | 5     | 317 272 009          | 266 831 895          |
| Paiements sur rachats  | 5     | (118 698 901)        | (105 591 722)        |
| <b>Trésorerie nette générée sur activités de financement</b>   |       | <b>198 573 108</b>   | <b>161 240 173</b>   |
| <b>Augmentation nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>  |       | <b>853 973</b>       | <b>648 860</b>       |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier   |       | 1 278 207            | 629 347              |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>  |       | <b>2 132 180</b>     | <b>1 278 207</b>     |
| <b>Informations supplémentaires</b>  |       |                      |                      |
| Impôts payés   |       | (1 728 564)          | (1 023 780)          |
| Intérêts payés   |       | -                    | (808)                |
| Dividendes reçus   |       | 11 327 328           | 6 750 676            |

\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF\*\*

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                              | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,66 % (mars 2022 : 99,73 %)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,65 % (mars 2022 : 97,00 %)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 97,65 %</b>                         |                  |                   |
| 66 007 Abbott Laboratories                                | 6 683 869        | 0,89              |
| 71 632 AbbVie Inc   | 11 415 992       | 1,52              |
| 19 030 Adobe Inc  | 7 333 591        | 0,98              |
| 21 496 Aflac Inc  | 1 386 922        | 0,18              |
| 11 777 Agilent Technologies Inc                           | 1 629 230        | 0,22              |
| 8 745 Air Products and Chemicals Inc                      | 2 511 651        | 0,33              |
| 10 189 Allstate   | 1 129 043        | 0,15              |
| 189 199 Alphabet Inc (Class A)                            | 19 625 612       | 2,61              |
| 165 097 Alphabet Inc (Class C)                            | 17 170 088       | 2,29              |
| 275 891 Amazon.com Inc                                    | 28 496 781       | 3,79              |
| 23 207 American Express                                   | 3 827 995        | 0,51              |
| 28 591 American International Group Inc                   | 1 439 843        | 0,19              |
| 7 479 American Water Works Co Inc                         | 1 095 599        | 0,15              |
| 19 797 Amgen Inc  | 4 785 925        | 0,64              |
| 454 000 Apple Inc   | 74 864 600       | 9,97              |
| 11 471 Aptiv PLC  | 1 286 932        | 0,17              |
| 19 896 Archer-Daniels-Midland Co                          | 1 584 915        | 0,21              |
| 10 673 Arista Networks Inc                                | 1 791 570        | 0,24              |
| 340 148 AT&T Inc  | 6 547 849        | 0,87              |
| 8 856 Autodesk Inc  | 1 843 465        | 0,25              |
| 40 171 Baker Hughes Co                                    | 1 159 335        | 0,15              |
| 12 457 Ball Corp  | 686 505          | 0,09              |
| 284 577 Bank of America Corp                              | 8 138 902        | 1,08              |
| 30 628 Bank of New York Mellon Corp                       | 1 391 736        | 0,19              |
| 19 177 Baxter International Inc                           | 777 819          | 0,10              |
| 7 794 Best Buy Co Inc                                     | 610 036          | 0,08              |
| 5 386 Biogen Inc  | 1 497 470        | 0,20              |
| 6 378 BlackRock Inc                                       | 4 267 647        | 0,57              |
| 9 000 BorgWarner Inc                                      | 441 990          | 0,06              |
| 7 368 Campbell Soup Co                                    | 405 093          | 0,05              |
| 13 907 Capital One Financial Corp                         | 1 337 297        | 0,18              |
| 34 211 Carrier Global Corp                                | 1 565 153        | 0,21              |
| 19 297 Caterpillar Inc                                    | 4 415 925        | 0,59              |
| 3 943 Cboe Global Markets Inc                             | 529 308          | 0,07              |
| 12 821 CBRE Group Inc                                     | 933 497          | 0,12              |
| 5 312 CDW Corp/DE   | 1 035 256        | 0,14              |
| 10 389 Cigna Group  | 2 654 701        | 0,35              |
| 5 898 Cincinnati Financial                                | 661 048          | 0,09              |
| 169 487 Cisco Systems Inc                                 | 8 859 933        | 1,18              |
| 76 001 Citigroup Inc                                      | 3 563 687        | 0,47              |
| 143 453 Coca-Cola   | 8 898 390        | 1,18              |
| 30 562 Colgate-Palmolive                                  | 2 296 734        | 0,31              |
| 162 594 Comcast Corp                                      | 6 163 939        | 0,82              |
| 5 263 Comerica Inc  | 228 519          | 0,03              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,66 % (mars 2022 : 99,73 %)</b>         |                  |                   |
| <b>(suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,65 % (mars 2022 : 97,00 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 97,65 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 13 346 Consolidated Edison Inc                                    | 1 276 812        | 0,17              |
| 31 381 Coming Inc   | 1 107 122        | 0,15              |
| 87 587 CSX Corp   | 2 622 355        | 0,35              |
| 5 613 Cummins Inc   | 1 340 833        | 0,18              |
| 47 717 CVS Health Corp  | 3 545 850        | 0,47              |
| 4 686 Darden Restaurants Inc                                      | 727 080          | 0,10              |
| 2 032 DaVita Inc  | 164 816          | 0,02              |
| 10 132 Deere & Co   | 4 183 300        | 0,56              |
| 5 541 Dover Corp  | 841 900          | 0,11              |
| 26 310 Dow Inc  | 1 442 314        | 0,19              |
| 15 691 Eaton Corp PLC   | 2 688 496        | 0,36              |
| 22 335 eBay   | 991 004          | 0,13              |
| 9 483 Ecolab Inc  | 1 569 721        | 0,21              |
| 14 433 Edison International                                       | 1 018 825        | 0,14              |
| 22 285 Edwards Lifesciences Corp                                  | 1 843 638        | 0,25              |
| 10 488 Electronic Arts Inc  | 1 263 280        | 0,17              |
| 8 646 Elevance Health Inc   | 3 975 517        | 0,53              |
| 30 149 Eli Lilly & Co   | 10 353 770       | 1,38              |
| 22 535 Emerson Electric Co  | 1 963 700        | 0,26              |
| 8 881 Estee Lauder  | 2 188 811        | 0,29              |
| 5 633 Etsy Inc  | 627 122          | 0,08              |
| 12 803 Eversource Energy  | 1 001 963        | 0,13              |
| 6 249 Expedia Group Inc   | 606 340          | 0,08              |
| 151 594 Exxon Mobil Corp  | 16 623 798       | 2,21              |
| 1 454 FactSet Research Systems Inc                                | 603 541          | 0,08              |
| 23 323 Fastenal Co  | 1 258 043        | 0,17              |
| 28 385 Fifth Third Bancorp  | 756 176          | 0,10              |
| 161 305 Ford Motor Co   | 2 032 443        | 0,27              |
| 13 988 Fortive Corp   | 953 562          | 0,13              |
| 55 717 Freeport-McMoRan Inc                                       | 2 279 382        | 0,30              |
| 21 706 Gen Digital Inc  | 372 475          | 0,05              |
| 2 763 Generac Holdings Inc  | 298 432          | 0,04              |
| 21 245 General Mills Inc  | 1 815 598        | 0,24              |
| 57 192 General Motors Co  | 2 097 803        | 0,28              |
| 45 774 Gilead Sciences Inc  | 3 797 869        | 0,51              |
| 3 260 Globe Life Inc  | 358 665          | 0,05              |
| 12 814 Goldman Sachs Group Inc                                    | 4 191 588        | 0,56              |
| 33 999 Halliburton Co   | 1 075 728        | 0,14              |
| 12 308 Hartford Financial Services Group Inc                      | 857 745          | 0,11              |
| 4 504 Hasbro Inc  | 241 820          | 0,03              |
| 5 358 Hershey Co  | 1 363 129        | 0,18              |
| 50 809 Hewlett Packard Enterprise Co                              | 809 387          | 0,11              |
| 9 698 Hilton Worldwide Holdings Inc                               | 1 366 157        | 0,18              |

## SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF\*\*

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,66 % (mars 2022 : 99,73 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,66 % (mars 2022 : 99,73 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,65 % (mars 2022 : 97,00 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 97,65 % (mars 2022 : 97,00 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 97,65 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 97,65 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 32 409 HP Inc   | 951 204          | 0,13              | 16 847 ONEOK Inc  | 1 070 458        | 0,14              |
| 2 839 IDEX Corp   | 655 894          | 0,09              | 61 794 Oracle Corp  | 5 741 898        | 0,76              |
| 11 106 Illinois Tool Works Inc                                    | 2 703 756        | 0,36              | 16 528 Otis Worldwide Corp  | 1 394 963        | 0,19              |
| 6 203 Illumina Inc  | 1 442 508        | 0,19              | 20 372 PACCAR Inc   | 1 491 230        | 0,20              |
| 16 061 Ingersoll Rand Inc   | 934 429          | 0,12              | 4 968 Parker-Hannifin Corp  | 1 669 794        | 0,22              |
| 166 805 Intel Corp  | 5 449 519        | 0,73              | 6 214 Pentair PLC   | 343 448          | 0,05              |
| 10 386 International Flavors & Fragrances Inc                     | 955 097          | 0,13              | 51 397 PepsiCo  | 9 369 673        | 1,25              |
| 14 223 Interpublic Group  | 529 665          | 0,07              | 17 680 Phillips 66  | 1 792 398        | 0,24              |
| 18 571 Invesco Ltd  | 304 564          | 0,04              | 8 853 Principal Financial Group Inc                               | 657 955          | 0,09              |
| 3 691 JB Hunt Transport Services Inc                              | 647 623          | 0,09              | 86 261 Procter & Gamble Co  | 12 826 148       | 1,71              |
| 26 869 Johnson Controls International PLC                         | 1 618 051        | 0,22              | 14 011 Prudential Financial Inc                                   | 1 159 270        | 0,15              |
| 119 105 JPMorgan Chase & Co                                       | 15 520 573       | 2,07              | 7 182 Raymond James Financial Inc                                 | 669 865          | 0,09              |
| 12 769 Juniper Networks Inc                                       | 439 509          | 0,06              | 4 098 Regeneron Pharmaceuticals Inc                               | 3 367 204        | 0,45              |
| 9 186 Kellogg Co  | 615 095          | 0,08              | 36 561 Regions Financial Corp                                     | 678 572          | 0,09              |
| 36 703 KeyCorp  | 459 522          | 0,06              | 8 011 Republic Services Inc                                       | 1 083 247        | 0,14              |
| 7 432 Keysight Technologies Inc                                   | 1 200 119        | 0,16              | 4 174 Robert Half International Inc                               | 336 299          | 0,04              |
| 74 628 Kinder Morgan Inc  | 1 306 736        | 0,17              | 4 605 Rockwell Automation Inc                                     | 1 351 337        | 0,18              |
| 28 495 Kraft Heinz Co   | 1 101 902        | 0,15              | 4 172 Roper Technologies  | 1 838 559        | 0,24              |
| 25 164 Kroger Co  | 1 242 347        | 0,17              | 8 507 Royal Caribbean Cruises Ltd                                 | 555 507          | 0,07              |
| 5 944 Lam Research  | 3 151 033        | 0,42              | 13 409 S&P Global Inc   | 4 623 021        | 0,62              |
| 5 836 Lincoln National Corp                                       | 131 135          | 0,02              | 44 708 Salesforce Inc   | 8 931 764        | 1,19              |
| 22 945 Lowe's Cos Inc   | 4 588 312        | 0,61              | 54 020 Schlumberger Ltd   | 2 652 382        | 0,35              |
| 16 743 Marathon Petroleum Corp                                    | 2 257 459        | 0,30              | 7 945 Seagate Technology Holdings PLC                             | 525 323          | 0,07              |
| 1 806 MarketAxess Holdings Inc                                    | 706 670          | 0,09              | 12 007 Sempra Energy  | 1 814 978        | 0,24              |
| 9 478 McCormick & Co Inc/MD                                       | 788 664          | 0,10              | 1 887 Snap-on   | 465 881          | 0,06              |
| 27 816 McDonald's Corp  | 7 777 632        | 1,04              | 5 530 Stanley Black & Decker Inc                                  | 445 607          | 0,06              |
| 94 399 Merck & Co Inc   | 10 043 110       | 1,34              | 50 893 Starbucks Corp   | 5 299 488        | 0,71              |
| 25 070 MetLife Inc  | 1 452 556        | 0,19              | 15 682 State Street Corp  | 1 186 971        | 0,16              |
| 898 Mettler-Toledo International Inc                              | 1 374 129        | 0,18              | 14 705 Synchrony Financial  | 427 621          | 0,06              |
| 234 351 Microsoft Corp  | 67 563 393       | 8,99              | 9 219 T Rowe Price Group Inc                                      | 1 040 825        | 0,14              |
| 14 737 Moderna Inc  | 2 263 308        | 0,30              | 7 069 Take-Two Interactive Software Inc                           | 843 332          | 0,11              |
| 50 989 Mondelez International Inc                                 | 3 554 953        | 0,47              | 15 342 Target   | 2 541 095        | 0,34              |
| 6 155 Moody's Corp  | 1 883 553        | 0,25              | 12 845 TE Connectivity Ltd  | 1 684 622        | 0,22              |
| 49 436 Morgan Stanley   | 4 340 481        | 0,58              | 36 246 Texas Instruments Inc                                      | 6 742 118        | 0,90              |
| 6 617 Motorola Solutions Inc                                      | 1 893 322        | 0,25              | 41 028 TJX Cos Inc  | 3 214 954        | 0,43              |
| 3 146 MSCI Inc  | 1 760 785        | 0,23              | 8 906 Trane Technologies PLC                                      | 1 638 526        | 0,22              |
| 13 847 Nasdaq Inc   | 757 015          | 0,10              | 9 473 Travelers Cos Inc   | 1 623 767        | 0,22              |
| 18 843 New Linde PLC  | 6 697 556        | 0,89              | 9 891 Trimble Inc   | 518 486          | 0,07              |
| 30 092 Newmont Mining   | 1 475 110        | 0,20              | 26 508 Union Pacific  | 5 335 000        | 0,71              |
| 48 304 Nike   | 5 924 003        | 0,79              | 32 139 United Parcel Service                                      | 6 234 645        | 0,83              |
| 2 053 Nordson Corp  | 456 300          | 0,06              | 2 783 United Rentals Inc  | 1 101 400        | 0,15              |
| 8 338 Northern Trust Corp   | 734 828          | 0,10              | 34 259 UnitedHealth Group Inc                                     | 16 190 461       | 2,15              |
| 122 467 NVIDIA Corp   | 34 017 659       | 4,53              | 54 631 US Bancorp   | 1 969 448        | 0,26              |



## SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF\*\*

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|--|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,66 % (mars 2022 : 99,73 %) (suite)</b>                  |                    |                   |
| <b>Actions ordinaires – 97,65 % (mars 2022 : 97,00 %) (suite)</b>                  |                    |                   |
| <b>Dollar américain – 97,65 % (suite)</b>  |                    |                   |
| 14 071 Valero Energy Corp  | 1 964 312          | 0,26              |
| 6 048 Verisk Analytics Inc   | 1 160 369          | 0,15              |
| 154 306 Verizon Communications Inc   | 6 000 960          | 0,80              |
| 9 164 Vertex Pharmaceuticals Inc   | 2 887 301          | 0,38              |
| 64 843 Visa Inc  | 14 619 503         | 1,95              |
| 7 654 W. R. Berkley  | 476 538            | 0,06              |
| 26 581 Walgreens Boots Alliance Inc  | 919 171            | 0,12              |
| 51 314 Walmart Inc   | 7 566 249          | 1,01              |
| 78 774 Walt Disney Co  | 7 887 641          | 1,05              |
| 14 472 Waste Management Inc  | 2 361 396          | 0,31              |
| 2 255 Waters Corp  | 698 216            | 0,09              |
| 7 301 Westinghouse Air Brake Technologies Corp                                     | 737 839            | 0,10              |
| 8 938 Westrock Co  | 272 341            | 0,04              |
| 2 148 Whirlpool Corp   | 283 579            | 0,04              |
| 44 615 Williams Cos Inc  | 1 332 204          | 0,18              |
| 4 251 Willis Towers Watson PLC   | 987 847            | 0,13              |
| 6 945 Xylem Inc/NY   | 727 142            | 0,10              |
| 10 382 Yum! Brands Inc   | 1 371 255          | 0,18              |
| 2 142 Zebra Technologies Corp  | 681 156            | 0,09              |
| 18 242 Zoetis Inc  | 3 036 198          | 0,40              |
| <b>Total des actions ordinaires</b>  | <b>733 561 138</b> | <b>97,65</b>      |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 2,01 % (mars 2022 : 2,73 %)</b> |                    |                   |
| <b>Dollar américain – 2,01 %</b>   |                    |                   |
| 5 355 AvalonBay Communities  | 899 961            | 0,12              |
| 5 431 Boston Properties  | 293 926            | 0,04              |
| 10 375 Digital Realty Trust Inc  | 1 019 966          | 0,14              |
| 3 481 Equinix Inc  | 2 509 940          | 0,33              |
| 4 823 Extra Space Storage Inc  | 785 812            | 0,11              |
| 2 845 Federal Realty Investment Trust  | 281 171            | 0,04              |
| 21 130 Healthpeak Properties Inc   | 464 226            | 0,06              |
| 27 776 Host Hotels & Resorts Inc   | 458 026            | 0,06              |
| 11 246 Iron Mountain Inc   | 595 026            | 0,08              |
| 22 764 Kimco Realty Corp   | 444 581            | 0,06              |
| 33 721 Prologis Inc  | 4 207 369          | 0,56              |
| 5 940 Regency Centers Corp   | 363 409            | 0,05              |
| 15 998 Ventas Inc  | 693 513            | 0,09              |
| 18 222 Welltower Inc   | 1 306 335          | 0,17              |

| Participation Investissement   | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|--|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,66 % (mars 2022 : 99,73 %) (suite)</b>                          |                    |                   |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 2,01 % (mars 2022 : 2,73 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Dollar américain – 2,01 % (suite)</b>   |                    |                   |
| 25 588 Weyerhaeuser Co   | 770 967            | 0,10              |
| <b>Total des fiducies de placement immobilier de type REIT</b>                             | <b>15 094 228</b>  | <b>2,01</b>       |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>  | <b>748 655 366</b> | <b>99,66</b>      |

**Instruments financiers dérivés – 0,01 % (mars 2022 : 0,01 %)**

**Contrats à terme standardisés – 0,01 % (mars 2022 : 0,01 %)**

| Montant notionnel | Prix du coût moyen   | Plus-values latentes USD | % des actifs nets |
|-------------------|--|--------------------------|-------------------|
| 1 363 240         | 341 8 of S&P 500 ESG E-mini Index Futures Long Contracts Expiring 16 June 2023 | 92 680                   | 0,01              |
|                   | <b>Plus-values latentes nettes sur contrats à terme standardisés</b>           | <b>92 680</b>            | <b>0,01</b>       |
|                   | <b>Total des instruments financiers dérivés</b>                                | <b>92 680</b>            | <b>0,01</b>       |

|   | Juste valeur USD   | % du Comp.    |
|---|--------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | <b>748 748 046</b> | <b>99,67</b>  |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,22 %)</b>                               | <b>2 132 180</b>   | <b>0,28</b>   |
| <b>Liquidités détenues auprès d'un courtier* (mars 2022 : néant)</b>                | <b>24 760</b>      | <b>0,00</b>   |
| <b>Montants à recevoir du courtier (mars 2022 : (0,01 %))</b>                       | <b>-</b>           | <b>-</b>      |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : 0,05 %)</b>                                      | <b>356 971</b>     | <b>0,05</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>751 261 957</b> | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company, à l'exception des liquidités détenues auprès d'un courtier, en l'occurrence Goldman Sachs.

Le courtier pour les contrats à terme standardisés ouverts est Goldman Sachs.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

\*\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

## SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF\*\*

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                        | <b>% du total des actifs</b> |
|---|------------------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs | 99,65                        |
| Instruments financiers dérivés négociés en Bourse                       | 0,01                         |
| Autres actifs   | 0,34                         |
| <b>Total des actifs</b>   | <b>100,00</b>                |

## SPDR S&P 500 UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|--|-------|----------------------|----------------------|
| <b>Actifs circulants</b>   |       |                      |                      |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                         | 1(e)  |                      |                      |
| Valeurs mobilières   |       | 5 260 283 189        | 6 391 683 241        |
| Instruments financiers dérivés   |       | 11 503 892           | 1 063 637            |
|  |       | <b>5 271 787 081</b> | <b>6 392 746 878</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie  | 1(f)  | 27 862 338           | 9 134 259            |
| Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties à des instruments financiers ouverts | 1(g)  | 566 928              | -                    |
| Créances :   |       |                      |                      |
| Dividendes à recevoir  |       | 3 255 240            | 3 450 182            |
| Produits divers à recevoir   |       | 182                  | 1 034                |
| À recevoir sur cessions d'actions de fonds   |       | 6 068 241            | 34 486 605           |
| <b>Total des actifs circulants</b>   |       | <b>5 309 540 010</b> | <b>6 439 818 958</b> |
| <b>Passifs circulants</b>  |       |                      |                      |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                        | 1(e)  |                      |                      |
| Instruments financiers dérivés   |       | (441 662)            | (5 221 680)          |
| Liquidités dues aux courtiers et aux contreparties pour des instruments financiers ouverts       | 1(g)  | -                    | (175 915)            |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :   |       |                      |                      |
| Charges à payer  |       | (399 323)            | (481 120)            |
| À payer sur achats d'investissements   |       | (6 067 797)          | (34 467 376)         |
| <b>Total des passifs circulants</b>  |       | <b>(6 908 782)</b>   | <b>(40 346 091)</b>  |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>              |       | <b>5 302 631 228</b> | <b>6 399 472 867</b> |
|  |       | <b>2023</b>          | <b>2022</b>          |
|  |       | <b>2021</b>          |                      |
| Valeur liquidative par action  |       |                      |                      |
| Catégorie couverte en EUR  | 5     | 10,29 EUR            | 11,62 EUR            |
| Catégorie non couverte en USD  | 5     | 410,39 USD           | 452,65 USD           |
|  |       | 10,18 EUR            | 396,94 USD           |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P 500 UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD        |
|--|-------|----------------------|--------------------|
| Produits de dividendes   |       | 93 264 689           | 86 411 984         |
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur   |       | 269                  | -                  |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat                 | 9     | (655 877 479)        | 752 559 709        |
| Produits divers  |       | 320 665              | 593                |
| <b>Total des (charges)/revenus d'investissement</b>  |       | <b>(562 291 856)</b> | <b>838 972 286</b> |
| Charges opérationnelles  | 3     | (5 028 989)          | (5 632 430)        |
| <b>(Perte)/Bénéfice net(te) pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(567 320 845)</b> | <b>833 339 856</b> |
| <b>Charges financières</b>   |       |                      |                    |
| Charges d'intérêts   |       | -                    | (9 971)            |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables  | 7     | (67 787 902)         | (62 238 155)       |
| <b>(Perte)/Bénéfice pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(635 108 747)</b> | <b>771 091 730</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement  | 2     | (13 858 920)         | (12 745 253)       |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(648 967 667)</b> | <b>758 346 477</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P 500 UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | 2023<br>USD            | 2022<br>USD          |
|--|------------------------|----------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier                              | 6 399 472 867          | 5 517 430 538        |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(648 967 667)</b>   | <b>758 346 477</b>   |
| <b>Opérations sur actions</b>  |                        |                      |
| Produits sur actions de participation rachetables émises   | 1 046 999 344          | 988 399 032          |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables   | (1 494 873 316)        | (864 703 180)        |
| (Diminution)/Augmentation des actifs nets résultant d'opérations sur actions   | (447 873 972)          | 123 695 852          |
| <b>(Diminution)/Augmentation totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                   | <b>(1 096 841 639)</b> | <b>882 042 329</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>                       | <b>5 302 631 228</b>   | <b>6 399 472 867</b> |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P 500 UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

| Notes  | 2023<br>USD          | 2022<br>USD         |
|--|----------------------|---------------------|
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(648 967 667)</b> | <b>758 346 477</b>  |
| <b>Ajustement pour :</b>   |                      |                     |
| Variation de la trésorerie détenue par/à payer au courtier   | (742 843)            | 469 720             |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat   | 1 103 000 473        | (790 388 724)       |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés  | (15 220 273)         | (6 792 044)         |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>  | <b>438 069 690</b>   | <b>(38 364 571)</b> |
| Variation des montants à recevoir  | 195 794              | (281 519)           |
| Variation des montants à payer   | (81 797)             | 53 864              |
| <b>Entrées/(Sorties) de trésorerie sur opérations</b>  | <b>113 997</b>       | <b>(227 655)</b>    |
| <b>Entrées/(Sorties) de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>   | <b>438 183 687</b>   | <b>(38 592 226)</b> |
| <b>Activités de financement</b>  |                      |                     |
| Produits des souscriptions   | 5 1 075 417 708      | 953 912 427         |
| Paiements sur rachats  | 5 (1 494 873 316)    | (912 336 290)       |
| <b>Trésorerie nette (utilisée)/générée sur activités de financement</b>  | <b>(419 455 608)</b> | <b>41 576 137</b>   |
| <b>Augmentation nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>  | <b>18 728 079</b>    | <b>2 983 911</b>    |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier   | 9 134 259            | 6 150 348           |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>  | <b>27 862 338</b>    | <b>9 134 259</b>    |
| <b>Informations supplémentaires</b>  |                      |                     |
| Impôts payés   | (13 858 920)         | (12 745 253)        |
| Intérêts reçus   | 269                  | -                   |
| Intérêts payés   | -                    | (9 971)             |
| Dividendes reçus   | 93 459 631           | 86 131 499          |
| Distributions payées   | (67 787 902)         | (62 238 155)        |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P 500 UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                              | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,20 % (mars 2022 : 99,88 %)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,73 % (mars 2022 : 97,26 %)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 96,73 %</b>                         |                  |                   |
| 83 676 3M Co  | 8 795 184        | 0,17              |
| 18 790 A O Smith Corp                                     | 1 299 329        | 0,02              |
| 266 172 Abbott Laboratories                               | 26 952 577       | 0,51              |
| 270 971 AbbVie Inc  | 43 184 648       | 0,81              |
| 96 674 Accenture PLC                                      | 27 630 396       | 0,52              |
| 108 818 Activision Blizzard Inc                           | 9 313 733        | 0,18              |
| 70 177 Adobe Inc  | 27 044 110       | 0,51              |
| 8 816 Advance Auto Parts Inc                              | 1 072 114        | 0,02              |
| 245 183 Advanced Micro Devices                            | 24 030 386       | 0,45              |
| 100 782 AES Corp  | 2 426 831        | 0,05              |
| 86 853 Aflac Inc  | 5 603 756        | 0,11              |
| 44 451 Agilent Technologies Inc                           | 6 149 351        | 0,12              |
| 33 904 Air Products and Chemicals Inc                     | 9 737 568        | 0,18              |
| 24 864 Akamai Technologies Inc                            | 1 946 851        | 0,04              |
| 18 464 Alaska Air Group Inc                               | 774 749          | 0,01              |
| 17 711 Albemarle  | 3 914 839        | 0,07              |
| 11 041 Align Technology Inc                               | 3 689 240        | 0,07              |
| 12 769 Allegion PLC                                       | 1 362 835        | 0,03              |
| 39 188 Alliant Energy Corp                                | 2 092 639        | 0,04              |
| 40 449 Allstate   | 4 482 154        | 0,08              |
| 914 194 Alphabet Inc (Class A)                            | 94 829 344       | 1,79              |
| 795 737 Alphabet Inc (Class C)                            | 82 756 648       | 1,56              |
| 273 522 Altria Group Inc                                  | 12 204 552       | 0,23              |
| 1 366 191 Amazon.com Inc                                  | 141 113 868      | 2,66              |
| 218 349 Amcor PLC   | 2 484 812        | 0,05              |
| 39 209 Ameren Corp  | 3 387 266        | 0,06              |
| 93 790 American Airlines Group Inc                        | 1 383 403        | 0,03              |
| 77 793 American Electric Power Co Inc                     | 7 078 385        | 0,13              |
| 91 617 American Express                                   | 15 112 224       | 0,29              |
| 114 469 American International Group Inc                  | 5 764 659        | 0,11              |
| 28 332 American Water Works Co Inc                        | 4 150 355        | 0,08              |
| 16 470 Ameriprise Financial Inc                           | 5 048 055        | 0,10              |
| 25 378 AmerisourceBergen Corp                             | 4 063 272        | 0,08              |
| 34 667 AMETEK   | 5 038 155        | 0,10              |
| 81 221 Amgen Inc  | 19 635 177       | 0,37              |
| 91 426 Amphenol Corp                                      | 7 471 333        | 0,14              |
| 77 621 Analog Devices                                     | 15 308 414       | 0,29              |
| 12 837 ANSYS Inc  | 4 272 154        | 0,08              |
| 31 569 Aon PLC  | 9 953 390        | 0,19              |
| 49 589 APA Corp   | 1 788 179        | 0,03              |
| 2 279 214 Apple Inc                                       | 375 842 389      | 7,09              |
| 129 164 Applied Materials                                 | 15 865 214       | 0,30              |
| 40 167 Aptiv PLC  | 4 506 336        | 0,09              |
| 55 898 Arch Capital Group Ltd                             | 3 793 797        | 0,07              |

| Participation Investissement                              | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,20 % (mars 2022 : 99,88 %)</b> |                  |                   |
| <b>(suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,73 % (mars 2022 : 97,26 %)</b> |                  |                   |
| <b>(suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 96,73 % (suite)</b>                 |                  |                   |
| 85 128 Archer-Daniels-Midland Co                          | 6 781 296        | 0,13              |
| 38 628 Arista Networks Inc                                | 6 484 096        | 0,12              |
| 32 735 Arthur J Gallagher & Co                            | 6 262 533        | 0,12              |
| 8 669 Assurant Inc  | 1 040 887        | 0,02              |
| 1 094 895 AT&T Inc  | 21 076 729       | 0,40              |
| 20 591 Atmos Energy Corp                                  | 2 313 605        | 0,04              |
| 33 036 Autodesk Inc                                       | 6 876 774        | 0,13              |
| 63 103 Automatic Data Processing                          | 14 048 621       | 0,26              |
| 2 870 AutoZone  | 7 054 890        | 0,13              |
| 12 761 Avery Dennison Corp                                | 2 283 326        | 0,04              |
| 156 448 Baker Hughes Co                                   | 4 515 089        | 0,09              |
| 47 753 Ball Corp  | 2 631 668        | 0,05              |
| 1 063 091 Bank of America Corp                            | 30 404 403       | 0,57              |
| 113 185 Bank of New York Mellon Corp                      | 5 143 126        | 0,10              |
| 37 081 Bath & Body Works Inc                              | 1 356 423        | 0,03              |
| 74 531 Baxter International Inc                           | 3 022 977        | 0,06              |
| 44 030 Becton Dickinson and Co                            | 10 899 186       | 0,21              |
| 275 750 Berkshire Hathaway Inc                            | 85 143 327       | 1,61              |
| 30 860 Best Buy Co Inc                                    | 2 415 412        | 0,05              |
| 22 340 Biogen Inc   | 6 211 190        | 0,12              |
| 3 339 Bio-Rad Laboratories Inc                            | 1 599 448        | 0,03              |
| 23 919 Bio-Techne Corp                                    | 1 774 551        | 0,03              |
| 23 075 BlackRock Inc                                      | 15 439 944       | 0,29              |
| 86 170 Boeing Co  | 18 305 093       | 0,35              |
| 5 912 Booking Holdings Inc                                | 15 681 048       | 0,30              |
| 38 492 BorgWarner Inc                                     | 1 890 342        | 0,04              |
| 217 448 Boston Scientific Corp                            | 10 878 923       | 0,21              |
| 323 538 Bristol-Myers Squibb Co                           | 22 424 419       | 0,42              |
| 64 036 Broadcom Inc                                       | 41 081 655       | 0,77              |
| 17 960 Broadridge Financial Solutions Inc                 | 2 632 397        | 0,05              |
| 35 770 Brown & Brown                                      | 2 053 913        | 0,04              |
| 29 489 Brown-Forman                                       | 1 895 258        | 0,04              |
| 22 916 Bunge Ltd  | 2 188 936        | 0,04              |
| 41 577 Cadence Design Systems Inc                         | 8 734 912        | 0,16              |
| 31 984 Caesars Entertainment Inc                          | 1 561 139        | 0,03              |
| 29 689 Campbell Soup Co                                   | 1 632 301        | 0,03              |
| 57 391 Capital One Financial Corp                         | 5 518 719        | 0,10              |
| 41 394 Cardinal Health Inc                                | 3 125 247        | 0,06              |
| 25 603 CarMax Inc   | 1 645 761        | 0,03              |
| 139 093 Carnival Corp                                     | 1 411 794        | 0,03              |
| 127 029 Carrier Global Corp                               | 5 811 577        | 0,11              |
| 25 475 Catalent Inc                                       | 1 673 962        | 0,03              |
| 79 402 Caterpillar Inc                                    | 18 170 354       | 0,34              |

## SPDR S&P 500 UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,20 % (mars 2022 : 99,88 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,20 % (mars 2022 : 99,88 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,73 % (mars 2022 : 97,26 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 96,73 % (mars 2022 : 97,26 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 96,73 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 96,73 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 15 632 Cboe Global Markets Inc                                    | 2 098 440        | 0,04              | 21 639 Cummins Inc  | 5 169 124        | 0,10              |
| 48 798 CBRE Group Inc   | 3 552 982        | 0,07              | 196 800 CVS Health Corp   | 14 624 208       | 0,28              |
| 20 826 CDW Corp/DE  | 4 058 779        | 0,08              | 100 478 Danaher Corp  | 25 324 475       | 0,48              |
| 15 476 Celanese Corp  | 1 685 182        | 0,03              | 18 625 Darden Restaurants Inc                                     | 2 889 855        | 0,05              |
| 87 108 Centene Corp   | 5 506 097        | 0,10              | 8 080 DaVita Inc  | 655 369          | 0,01              |
| 95 880 CenterPoint Energy Inc                                     | 2 824 625        | 0,05              | 41 725 Deere & Co   | 17 227 418       | 0,32              |
| 23 286 Ceridian HCM Holding Inc                                   | 1 705 001        | 0,03              | 97 797 Delta Air Lines Inc  | 3 415 071        | 0,06              |
| 31 242 CF Industries Holdings Inc                                 | 2 264 733        | 0,04              | 34 688 DENTSPLY SIRONA Inc  | 1 362 545        | 0,03              |
| 18 468 CH Robinson Worldwide Inc                                  | 1 835 165        | 0,03              | 98 856 Devon Energy Corp  | 5 003 102        | 0,09              |
| 7 656 Charles River Laboratories International Inc                | 1 545 134        | 0,03              | 57 918 Dexcom Inc   | 6 728 913        | 0,13              |
| 234 332 Charles Schwab Corp                                       | 12 274 310       | 0,23              | 27 660 Diamondback Energy Inc                                     | 3 738 802        | 0,07              |
| 16 393 Charter Communications Inc                                 | 5 862 301        | 0,11              | 41 648 Discover Financial Services                                | 4 116 488        | 0,08              |
| 271 808 Chevron Corp  | 44 348 193       | 0,84              | 36 301 DISH Network Corp  | 338 688          | 0,01              |
| 4 246 Chipotle Mexican Grill Inc                                  | 7 253 399        | 0,14              | 33 986 Dollar General Corp  | 7 152 694        | 0,13              |
| 63 723 Chubb Ltd  | 12 373 732       | 0,23              | 32 153 Dollar Tree Inc  | 4 615 563        | 0,09              |
| 37 993 Church & Dwight Co Inc                                     | 3 358 961        | 0,06              | 128 375 Dominion Energy Inc                                       | 7 177 446        | 0,14              |
| 46 371 Cigna Group  | 11 849 182       | 0,22              | 5 666 Domino's Pizza Inc  | 1 869 043        | 0,04              |
| 23 971 Cincinnati Financial                                       | 2 686 670        | 0,05              | 21 384 Dover Corp   | 3 249 085        | 0,06              |
| 13 090 Cintas Corp  | 6 056 481        | 0,11              | 106 406 Dow Inc   | 5 833 177        | 0,11              |
| 625 149 Cisco Systems Inc   | 32 679 664       | 0,62              | 48 746 DR Horton  | 4 761 997        | 0,09              |
| 294 217 Citigroup Inc   | 13 795 835       | 0,26              | 28 996 DTE Energy Co  | 3 176 222        | 0,06              |
| 75 668 Citizens Financial Group Inc                               | 2 298 037        | 0,04              | 117 564 Duke Energy Corp  | 11 341 399       | 0,21              |
| 19 389 Clorox Co  | 3 068 115        | 0,06              | 70 197 DuPont de Nemours Inc                                      | 5 038 039        | 0,10              |
| 55 529 CME Group Inc  | 10 634 914       | 0,20              | 32 313 DXC Technology Co  | 825 920          | 0,02              |
| 45 950 CMS Energy Corp  | 2 820 411        | 0,05              | 17 649 Eastman Chemical Co  | 1 488 517        | 0,03              |
| 596 506 Coca-Cola   | 37 001 267       | 0,70              | 60 548 Eaton Corp PLC   | 10 374 294       | 0,20              |
| 80 036 Cognizant Technology Solutions Corp                        | 4 876 593        | 0,09              | 83 452 eBay   | 3 702 765        | 0,07              |
| 127 859 Colgate-Palmolive   | 9 608 604        | 0,18              | 38 340 Ecolab Inc   | 6 346 420        | 0,12              |
| 644 686 Comcast Corp  | 24 440 046       | 0,46              | 59 347 Edison International                                       | 4 189 305        | 0,08              |
| 20 546 Comerica Inc   | 892 107          | 0,02              | 93 649 Edwards Lifesciences Corp                                  | 7 747 582        | 0,15              |
| 74 678 Conagra Brands Inc   | 2 804 906        | 0,05              | 40 601 Electronic Arts Inc  | 4 890 390        | 0,09              |
| 187 544 ConocoPhillips  | 18 606 240       | 0,35              | 36 621 Elevance Health Inc  | 16 838 702       | 0,32              |
| 54 051 Consolidated Edison Inc                                    | 5 171 059        | 0,10              | 120 778 Eli Lilly & Co  | 41 477 581       | 0,78              |
| 25 254 Constellation Brands Inc                                   | 5 704 626        | 0,11              | 89 827 Emerson Electric Co  | 7 827 525        | 0,15              |
| 50 065 Constellation Energy Corp                                  | 3 930 103        | 0,07              | 20 707 Enphase Energy Inc   | 4 354 268        | 0,08              |
| 7 525 Cooper Cos Inc  | 2 809 534        | 0,05              | 30 398 Entergy Corp   | 3 275 081        | 0,06              |
| 64 539 Copart   | 4 853 978        | 0,09              | 89 041 EOG Resources Inc  | 10 206 770       | 0,19              |
| 116 329 Corning Inc   | 4 104 087        | 0,08              | 8 668 EPAM Systems Inc  | 2 591 732        | 0,05              |
| 110 792 Corteva Inc   | 6 681 866        | 0,13              | 56 250 EQT Corp   | 1 794 938        | 0,03              |
| 63 460 CoStar Group Inc   | 4 369 221        | 0,08              | 18 683 Equifax Inc  | 3 789 660        | 0,07              |
| 67 991 Costco Wholesale Corp                                      | 33 782 688       | 0,64              | 34 873 Estee Lauder   | 8 594 800        | 0,16              |
| 124 367 Coterra Energy Inc  | 3 051 966        | 0,06              | 19 073 Etsy Inc   | 2 123 397        | 0,04              |
| 319 715 CSX Corp  | 9 572 267        | 0,18              | 6 175 Everest Re Group  | 2 210 774        | 0,04              |



## SPDR S&P 500 UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,20 % (mars 2022 : 99,88 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,73 % (mars 2022 : 97,26 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 96,73 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 35 656 Evergy Inc   | 2 179 295        | 0,04              |
| 52 687 Eversource Energy  | 4 123 285        | 0,08              |
| 149 941 Exelon Corp   | 6 281 028        | 0,12              |
| 22 957 Expedia Group Inc  | 2 227 518        | 0,04              |
| 24 274 Expeditors International of Washington                     | 2 673 053        | 0,05              |
| 630 510 Exxon Mobil Corp  | 69 141 727       | 1,30              |
| 9 016 F5 Networks   | 1 313 541        | 0,02              |
| 5 685 FactSet Research Systems Inc                                | 2 359 787        | 0,04              |
| 3 835 Fair Isaac Corp   | 2 694 816        | 0,05              |
| 86 383 Fastenal Co  | 4 659 499        | 0,09              |
| 36 165 FedEx Corp   | 8 263 341        | 0,16              |
| 90 998 Fidelity National Information Services Inc                 | 4 943 921        | 0,09              |
| 105 892 Fifth Third Bancorp                                       | 2 820 963        | 0,05              |
| 27 348 First Republic Bank/CA                                     | 382 599          | 0,01              |
| 15 856 First Solar Inc  | 3 448 680        | 0,07              |
| 82 415 FirstEnergy Corp   | 3 301 545        | 0,06              |
| 96 725 Fiserv Inc   | 10 932 827       | 0,21              |
| 11 850 FleetCor Technologies Inc                                  | 2 498 573        | 0,05              |
| 20 030 FMC  | 2 446 264        | 0,05              |
| 599 655 Ford Motor Co   | 7 555 653        | 0,14              |
| 99 410 Fortinet Inc   | 6 606 789        | 0,12              |
| 52 653 Fortive Corp   | 3 589 355        | 0,07              |
| 43 444 Fox Corp (Class A)   | 1 479 268        | 0,03              |
| 25 124 Fox Corp (Class B)   | 786 632          | 0,01              |
| 45 560 Franklin Resources Inc                                     | 1 227 386        | 0,02              |
| 217 189 Freeport-McMoRan Inc                                      | 8 885 202        | 0,17              |
| 22 480 Garmin Ltd   | 2 268 682        | 0,04              |
| 12 273 Gartner  | 3 998 175        | 0,08              |
| 55 534 GE HealthCare Technologies Inc                             | 4 555 454        | 0,09              |
| 91 125 Gen Digital Inc  | 1 563 705        | 0,03              |
| 9 709 Generac Holdings Inc  | 1 048 669        | 0,02              |
| 34 511 General Dynamics Corp                                      | 7 875 755        | 0,15              |
| 166 619 General Electric Co                                       | 15 928 776       | 0,30              |
| 91 604 General Mills Inc  | 7 828 478        | 0,15              |
| 216 964 General Motors Co   | 7 958 240        | 0,15              |
| 22 182 Genuine Parts Co   | 3 711 270        | 0,07              |
| 190 380 Gilead Sciences Inc                                       | 15 795 829       | 0,30              |
| 40 261 Global Payments Inc  | 4 237 068        | 0,08              |
| 14 342 Globe Life Inc   | 1 577 907        | 0,03              |
| 51 489 Goldman Sachs Group Inc                                    | 16 842 567       | 0,32              |
| 136 294 Halliburton Co  | 4 312 342        | 0,08              |
| 49 114 Hartford Financial Services Group Inc                      | 3 422 755        | 0,06              |
| 20 589 Hasbro Inc   | 1 105 423        | 0,02              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,20 % (mars 2022 : 99,88 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,73 % (mars 2022 : 97,26 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 96,73 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 32 454 HCA Healthcare Inc   | 8 557 471        | 0,16              |
| 22 003 Henry Schein Inc   | 1 794 125        | 0,03              |
| 22 389 Hershey Co   | 5 695 985        | 0,11              |
| 42 458 Hess Corp  | 5 618 892        | 0,11              |
| 202 954 Hewlett Packard Enterprise Co                             | 3 233 057        | 0,06              |
| 41 541 Hilton Worldwide Holdings Inc                              | 5 851 881        | 0,11              |
| 39 046 Hologic  | 3 151 012        | 0,06              |
| 156 265 Home Depot Inc  | 46 116 927       | 0,87              |
| 102 348 Honeywell International Inc                               | 19 560 750       | 0,37              |
| 44 507 Hormel Foods Corp  | 1 774 939        | 0,03              |
| 53 855 Howmet Aerospace Inc                                       | 2 281 836        | 0,04              |
| 133 574 HP Inc  | 3 920 397        | 0,07              |
| 19 287 Humana   | 9 363 067        | 0,18              |
| 227 566 Huntington Bancshares                                     | 2 548 739        | 0,05              |
| 6 171 Huntington Ingalls Industries Inc                           | 1 277 520        | 0,02              |
| 11 735 IDEX Corp  | 2 711 137        | 0,05              |
| 12 755 IDEXX Laboratories Inc                                     | 6 378 520        | 0,12              |
| 43 097 Illinois Tool Works Inc                                    | 10 491 965       | 0,20              |
| 23 909 Illumina Inc   | 5 560 038        | 0,10              |
| 28 692 Incyte Corp  | 2 073 571        | 0,04              |
| 62 313 Ingersoll Rand Inc   | 3 625 370        | 0,07              |
| 10 596 Insolet Corp   | 3 379 700        | 0,06              |
| 627 689 Intel Corp  | 20 506 600       | 0,39              |
| 85 725 Intercontinental Exchange Inc                              | 8 940 260        | 0,17              |
| 137 345 International Business Machines Corp                      | 18 004 556       | 0,34              |
| 38 540 International Flavors & Fragrances Inc                     | 3 544 138        | 0,07              |
| 53 633 International Paper Co                                     | 1 934 006        | 0,04              |
| 59 349 Interpublic Group  | 2 210 157        | 0,04              |
| 42 895 Intuit   | 19 123 878       | 0,36              |
| 54 058 Intuitive Surgical Inc                                     | 13 810 197       | 0,26              |
| 62 517 Invesco Ltd  | 1 025 279        | 0,02              |
| 28 374 IQVIA Holdings Inc   | 5 643 305        | 0,11              |
| 16 189 J M Smucker Co   | 2 547 663        | 0,05              |
| 11 033 Jack Henry & Associates Inc                                | 1 662 894        | 0,03              |
| 18 685 Jacobs Solutions Inc                                       | 2 195 674        | 0,04              |
| 13 160 JB Hunt Transport Services Inc                             | 2 309 054        | 0,04              |
| 400 282 Johnson & Johnson   | 62 043 710       | 1,17              |
| 104 883 Johnson Controls International PLC                        | 6 316 054        | 0,12              |
| 449 161 JPMorgan Chase & Co                                       | 58 530 170       | 1,10              |
| 50 381 Juniper Networks Inc                                       | 1 734 114        | 0,03              |
| 37 366 Kellogg Co   | 2 502 027        | 0,05              |
| 127 390 Keurig Dr Pepper Inc                                      | 4 494 319        | 0,08              |
| 136 342 KeyCorp   | 1 707 002        | 0,03              |

## SPDR S&P 500 UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,20 % (mars 2022 : 99,88 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,20 % (mars 2022 : 99,88 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,73 % (mars 2022 : 97,26 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 96,73 % (mars 2022 : 97,26 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 96,73 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 96,73 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 27 708 Keysight Technologies Inc                                  | 4 474 288        | 0,08              | 8 689 Mohawk Industries Inc                                       | 870 812          | 0,02              |
| 51 375 Kimberly-Clark Corp  | 6 895 553        | 0,13              | 8 927 Molina Healthcare Inc                                       | 2 387 883        | 0,05              |
| 297 744 Kinder Morgan Inc   | 5 213 497        | 0,10              | 30 873 Molson Coors Beverage Co                                   | 1 595 517        | 0,03              |
| 21 534 KLA Corp   | 8 595 727        | 0,16              | 209 248 Mondelez International Inc                                | 14 588 771       | 0,28              |
| 124 147 Kraft Heinz Co  | 4 800 764        | 0,09              | 6 486 Monolithic Power Systems Inc                                | 3 246 502        | 0,06              |
| 99 753 Kroger Co  | 4 924 806        | 0,09              | 116 489 Monster Beverage Corp                                     | 6 291 571        | 0,12              |
| 29 384 L3Harris Technologies Inc                                  | 5 766 316        | 0,11              | 23 744 Moody's Corp   | 7 266 139        | 0,14              |
| 13 999 Laboratory Corp of America Holdings                        | 3 211 651        | 0,06              | 200 330 Morgan Stanley  | 17 588 974       | 0,33              |
| 20 844 Lam Research   | 11 049 821       | 0,21              | 53 801 Mosaic Co  | 2 468 390        | 0,05              |
| 22 314 Lamb Weston Holdings Inc                                   | 2 332 259        | 0,04              | 25 331 Motorola Solutions Inc                                     | 7 247 959        | 0,14              |
| 48 443 Las Vegas Sands Corp                                       | 2 783 050        | 0,05              | 12 450 MSCI Inc   | 6 968 140        | 0,13              |
| 20 132 Leidos Holdings Inc  | 1 853 352        | 0,03              | 52 990 Nasdaq Inc   | 2 896 963        | 0,05              |
| 38 400 Lennar   | 4 036 224        | 0,08              | 32 902 NetApp Inc   | 2 100 793        | 0,04              |
| 23 111 Lincoln National Corp                                      | 519 304          | 0,01              | 68 354 Netflix Inc  | 23 614 940       | 0,45              |
| 20 022 Live Nation Entertainment Inc                              | 1 401 540        | 0,03              | 75 332 New Linde PLC  | 26 776 006       | 0,51              |
| 38 951 LKQ Corp   | 2 210 859        | 0,04              | 59 610 Newell Brands Inc  | 741 548          | 0,01              |
| 34 861 Lockheed Martin Corp                                       | 16 479 841       | 0,31              | 120 748 Newmont Mining  | 5 919 067        | 0,11              |
| 28 756 Loews Corp   | 1 668 423        | 0,03              | 58 818 News (Class A)   | 1 015 787        | 0,02              |
| 92 713 Lowe's Cos Inc   | 18 539 819       | 0,35              | 18 440 News Corp (Class B)  | 321 409          | 0,01              |
| 39 245 LyondellBasell Industries NV                               | 3 684 713        | 0,07              | 302 772 NextEra Energy Inc  | 23 337 666       | 0,44              |
| 26 485 M&T Bank   | 3 166 811        | 0,06              | 190 875 Nike  | 23 408 910       | 0,44              |
| 95 752 Marathon Oil Corp  | 2 294 218        | 0,04              | 58 664 NiSource Inc   | 1 640 245        | 0,03              |
| 69 584 Marathon Petroleum Corp                                    | 9 382 011        | 0,18              | 8 259 Nordson Corp  | 1 835 645        | 0,03              |
| 5 875 MarketAxess Holdings Inc                                    | 2 298 829        | 0,04              | 35 393 Norfolk Southern Corp                                      | 7 503 316        | 0,14              |
| 40 563 Marriott International Inc/MD                              | 6 735 081        | 0,13              | 32 142 Northern Trust Corp  | 2 832 674        | 0,05              |
| 76 159 Marsh & McLennan Cos Inc                                   | 12 684 281       | 0,24              | 22 043 Northrop Grumman Corp                                      | 10 177 694       | 0,19              |
| 9 385 Martin Marietta Materials Inc                               | 3 332 238        | 0,06              | 71 874 Norwegian Cruise Line Holdings Ltd                         | 966 705          | 0,02              |
| 32 596 Masco Corp   | 1 620 673        | 0,03              | 35 767 NRG Energy Inc   | 1 226 450        | 0,02              |
| 129 623 Mastercard Inc  | 47 106 294       | 0,89              | 38 653 Nucor Corp   | 5 970 729        | 0,11              |
| 42 296 Match Group Inc  | 1 623 743        | 0,03              | 376 966 NVIDIA Corp   | 104 709 846      | 1,97              |
| 39 056 McCormick & Co Inc/MD                                      | 3 249 850        | 0,06              | 463 NVR Inc   | 2 579 924        | 0,05              |
| 112 289 McDonald's Corp   | 31 397 127       | 0,59              | 40 309 NXP Semiconductors NV                                      | 7 516 621        | 0,14              |
| 20 956 McKesson Corp  | 7 461 384        | 0,14              | 111 279 Occidental Petroleum Corp                                 | 6 947 148        | 0,13              |
| 204 509 Medtronic PLC   | 16 487 516       | 0,31              | 13 764 Old Dominion Freight Line                                  | 4 691 322        | 0,09              |
| 388 463 Merck & Co Inc  | 41 328 579       | 0,78              | 31 111 Omnicom Group Inc  | 2 935 012        | 0,06              |
| 341 141 Meta Platforms Inc  | 72 301 424       | 1,36              | 66 076 ON Semiconductor Corp                                      | 5 439 376        | 0,10              |
| 101 862 MetLife Inc   | 5 901 884        | 0,11              | 68 108 ONEOK Inc  | 4 327 582        | 0,08              |
| 3 404 Mettler-Toledo International Inc                            | 5 208 835        | 0,10              | 236 120 Oracle Corp   | 21 940 270       | 0,41              |
| 49 562 MGM Resorts International                                  | 2 201 544        | 0,04              | 9 698 O'Reilly Automotive Inc                                     | 8 233 408        | 0,16              |
| 85 120 Microchip Technology Inc                                   | 7 131 354        | 0,13              | 38 851 Organon & Co   | 913 776          | 0,02              |
| 167 421 Micron Technology Inc                                     | 10 102 183       | 0,19              | 63 490 Otis Worldwide Corp  | 5 358 556        | 0,10              |
| 1 139 960 Microsoft Corp  | 328 650 468      | 6,20              | 79 489 PACCAR Inc   | 5 818 595        | 0,11              |
| 50 160 Moderna Inc  | 7 703 573        | 0,15              | 14 369 Packaging Corp of America                                  | 1 994 848        | 0,04              |

## SPDR S&P 500 UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,20 % (mars 2022 : 99,88 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,73 % (mars 2022 : 97,26 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 96,73 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 76 656 Paramount Global   | 1 710 195        | 0,03              |
| 19 281 Parker-Hannifin Corp                                       | 6 480 537        | 0,12              |
| 49 848 Paychex  | 5 712 082        | 0,11              |
| 7 191 Paycom Software Inc   | 2 186 136        | 0,04              |
| 172 984 PayPal Holdings Inc                                       | 13 136 405       | 0,25              |
| 25 964 Pentair PLC  | 1 435 030        | 0,03              |
| 211 118 PepsiCo   | 38 486 811       | 0,73              |
| 19 342 PerkinElmer  | 2 577 515        | 0,05              |
| 860 033 Pfizer Inc  | 35 089 346       | 0,66              |
| 244 883 PG&E Corp   | 3 959 758        | 0,07              |
| 235 803 Philip Morris International Inc                           | 22 931 842       | 0,43              |
| 71 315 Phillips 66  | 7 229 915        | 0,14              |
| 16 782 Pinnacle West Capital Corp                                 | 1 329 806        | 0,03              |
| 36 029 Pioneer Natural Resources Co                               | 7 358 563        | 0,14              |
| 61 492 PNC Financial Services Group Inc                           | 7 815 633        | 0,15              |
| 5 964 Pool Corp   | 2 042 312        | 0,04              |
| 36 104 PPG Industries Inc   | 4 822 772        | 0,09              |
| 114 913 PPL Corp  | 3 193 432        | 0,06              |
| 34 539 Principal Financial Group Inc                              | 2 566 938        | 0,05              |
| 361 798 Procter & Gamble Co                                       | 53 795 745       | 1,01              |
| 88 887 Progressive  | 12 716 174       | 0,24              |
| 55 845 Prudential Financial Inc                                   | 4 620 615        | 0,09              |
| 16 275 PTC Inc  | 2 086 943        | 0,04              |
| 77 485 Public Service Enterprise Group Inc                        | 4 838 938        | 0,09              |
| 36 251 PulteGroup   | 2 112 708        | 0,04              |
| 15 174 Qorvo Inc  | 1 541 223        | 0,03              |
| 172 237 QUALCOMM Inc  | 21 973 996       | 0,41              |
| 21 965 Quanta Services Inc  | 3 660 248        | 0,07              |
| 17 699 Quest Diagnostics  | 2 504 055        | 0,05              |
| 6 307 Ralph Lauren Corp   | 735 838          | 0,01              |
| 28 976 Raymond James Financial Inc                                | 2 702 592        | 0,05              |
| 225 009 Raytheon Technologies Corp                                | 22 035 131       | 0,42              |
| 16 270 Regeneron Pharmaceuticals Inc                              | 13 368 571       | 0,25              |
| 145 036 Regions Financial Corp                                    | 2 691 868        | 0,05              |
| 30 784 Republic Services Inc                                      | 4 162 612        | 0,08              |
| 22 734 ResMed Inc   | 4 978 519        | 0,09              |
| 17 343 Robert Half International Inc                              | 1 397 326        | 0,03              |
| 17 701 Rockwell Automation Inc                                    | 5 194 358        | 0,10              |
| 33 493 Rollins Inc  | 1 256 992        | 0,02              |
| 16 228 Roper Technologies   | 7 151 517        | 0,13              |
| 53 697 Ross Stores  | 5 698 863        | 0,11              |
| 33 574 Royal Caribbean Cruises Ltd                                | 2 192 382        | 0,04              |
| 50 435 S&P Global Inc   | 17 388 475       | 0,33              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,20 % (mars 2022 : 99,88 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,73 % (mars 2022 : 97,26 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 96,73 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 152 057 Salesforce Inc  | 30 377 947       | 0,57              |
| 214 426 Schlumberger Ltd  | 10 528 317       | 0,20              |
| 30 904 Seagate Technology Holdings PLC                            | 2 043 372        | 0,04              |
| 21 824 Sealed Air Corp  | 1 001 940        | 0,02              |
| 48 240 Sempra Energy  | 7 291 958        | 0,14              |
| 31 090 ServiceNow Inc   | 14 448 145       | 0,27              |
| 36 001 Sherwin-Williams   | 8 091 945        | 0,15              |
| 25 318 Skyworks Solutions Inc                                     | 2 987 018        | 0,06              |
| 7 643 Snap-on   | 1 886 980        | 0,04              |
| 8 197 SolarEdge Technologies Inc                                  | 2 491 478        | 0,05              |
| 167 834 Southern Co   | 11 677 890       | 0,22              |
| 92 355 Southwest Airlines Co                                      | 3 005 232        | 0,06              |
| 23 340 Stanley Black & Decker Inc                                 | 1 880 737        | 0,04              |
| 174 305 Starbucks Corp  | 18 150 380       | 0,34              |
| 55 847 State Street Corp  | 4 227 059        | 0,08              |
| 25 532 Steel Dynamics Inc   | 2 886 648        | 0,05              |
| 15 286 STERIS PLC   | 2 923 906        | 0,06              |
| 51 076 Stryker  | 14 580 666       | 0,28              |
| 71 013 Synchrony Financial  | 2 065 058        | 0,04              |
| 23 568 Synopsys Inc   | 9 103 140        | 0,17              |
| 77 166 Sysco Corp   | 5 959 530        | 0,11              |
| 34 681 T Rowe Price Group Inc                                     | 3 915 485        | 0,07              |
| 24 053 Take-Two Interactive Software Inc                          | 2 869 523        | 0,05              |
| 36 368 Tapestry Inc   | 1 567 824        | 0,03              |
| 34 347 Targa Resources Corp                                       | 2 505 614        | 0,05              |
| 70 277 Target   | 11 639 980       | 0,22              |
| 48 642 TE Connectivity Ltd  | 6 379 398        | 0,12              |
| 7 369 Teledyne Technologies Inc                                   | 3 296 596        | 0,06              |
| 7 097 Teleflex Inc  | 1 797 741        | 0,03              |
| 24 432 Teradyne Inc   | 2 626 684        | 0,05              |
| 411 115 Tesla Inc   | 85 289 918       | 1,61              |
| 138 624 Texas Instruments Inc                                     | 25 785 450       | 0,49              |
| 32 164 Textron Inc  | 2 271 743        | 0,04              |
| 60 118 Thermo Fisher Scientific                                   | 34 650 212       | 0,65              |
| 178 288 TJX Cos Inc   | 13 970 648       | 0,26              |
| 90 450 T-Mobile US Inc  | 13 100 778       | 0,25              |
| 16 620 Tractor Supply Co  | 3 906 365        | 0,07              |
| 35 851 Trane Technologies PLC                                     | 6 595 867        | 0,12              |
| 7 968 TransDigm Group Inc   | 5 872 814        | 0,11              |
| 35 695 Travelers Cos Inc  | 6 118 480        | 0,12              |
| 38 548 Trimble Inc  | 2 020 686        | 0,04              |
| 201 528 Truist Financial Corp                                     | 6 872 105        | 0,13              |
| 6 286 Tyler Technologies Inc                                      | 2 229 267        | 0,04              |

## SPDR S&P 500 UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement   | Juste valeur USD     | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|--|----------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,20 % (mars 2022 : 99,88 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,20 % (mars 2022 : 99,88 %) (suite)</b>                  |                      |                   |
| <b>Actions ordinaires – 96,73 % (mars 2022 : 97,26 %) (suite)</b> |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 96,73 % (mars 2022 : 97,26 %) (suite)</b>                  |                      |                   |
| <b>Dollar américain – 96,73 % (suite)</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 96,73 % (suite)</b>  |                      |                   |
| 45 179 Tyson Foods Inc  | 2 680 018        | 0,05              | 32 233 Zimmer Biomet Holdings Inc  | 4 164 504            | 0,08              |
| 7 950 Ulta Beauty Inc   | 4 338 077        | 0,08              | 21 594 Zions Bancorp NA  | 646 308              | 0,01              |
| 93 849 Union Pacific  | 18 888 050       | 0,36              | 71 142 Zoetis Inc  | 11 840 874           | 0,22              |
| 50 506 United Airlines Holdings Inc                               | 2 234 891        | 0,04              |  |                      |                   |
| 112 173 United Parcel Service                                     | 21 760 440       | 0,41              | <b>Total des actions ordinaires</b>  | <b>5 129 499 412</b> | <b>96,73</b>      |
| 10 970 United Rentals Inc   | 4 341 487        | 0,08              | <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 2,47 % (mars 2022 : 2,62 %)</b> |                      |                   |
| 143 021 UnitedHealth Group Inc                                    | 67 590 294       | 1,27              | <b>Dollar américain – 2,47 %</b>   |                      |                   |
| 9 814 Universal Health Services Inc                               | 1 247 359        | 0,02              | 24 115 Alexandria Real Estate Equities Inc   | 3 028 603            | 0,06              |
| 213 540 US Bancorp  | 7 698 117        | 0,15              | 70 759 American Tower Corp   | 14 458 894           | 0,27              |
| 59 088 Valero Energy Corp   | 8 248 685        | 0,16              | 21 278 AvalonBay Communities   | 3 575 981            | 0,07              |
| 14 691 VeriSign Inc   | 3 104 649        | 0,06              | 20 534 Boston Properties   | 1 111 300            | 0,02              |
| 23 498 Verisk Analytics Inc                                       | 4 508 326        | 0,09              | 16 895 Camden Property Trust   | 1 771 272            | 0,03              |
| 644 539 Verizon Communications Inc                                | 25 066 122       | 0,47              | 66 286 Crown Castle Inc  | 8 871 718            | 0,17              |
| 38 892 Vertex Pharmaceuticals Inc                                 | 12 253 702       | 0,23              | 44 137 Digital Realty Trust Inc  | 4 339 108            | 0,08              |
| 50 036 VF Corp  | 1 146 325        | 0,02              | 14 122 Equinix Inc   | 10 182 527           | 0,19              |
| 187 949 Viatis Inc  | 1 808 069        | 0,03              | 52 067 Equity Residential  | 3 124 020            | 0,06              |
| 249 007 Visa Inc  | 56 141 118       | 1,06              | 9 881 Essex Property Trust Inc   | 2 066 512            | 0,04              |
| 19 654 Vulcan Materials Co  | 3 371 840        | 0,06              | 19 850 Extra Space Storage Inc   | 3 234 160            | 0,06              |
| 31 008 W. R. Berkley  | 1 930 558        | 0,04              | 10 730 Federal Realty Investment Trust   | 1 060 446            | 0,02              |
| 109 510 Walgreens Boots Alliance Inc                              | 3 786 856        | 0,07              | 84 701 Healthpeak Properties Inc   | 1 860 881            | 0,04              |
| 215 582 Walmart Inc   | 31 787 566       | 0,60              | 111 281 Host Hotels & Resorts Inc  | 1 835 024            | 0,03              |
| 279 814 Walt Disney Co  | 28 017 776       | 0,53              | 88 952 Invitation Homes Inc  | 2 777 971            | 0,05              |
| 333 165 Warner Bros Discovery Inc                                 | 5 030 792        | 0,09              | 46 172 Iron Mountain Inc   | 2 442 961            | 0,05              |
| 57 107 Waste Management Inc                                       | 9 318 149        | 0,18              | 91 806 Kimco Realty Corp   | 1 792 971            | 0,03              |
| 8 915 Waters Corp   | 2 760 351        | 0,05              | 17 724 Mid-America Apartment Communities Inc                                       | 2 677 033            | 0,05              |
| 48 453 WEC Energy Group Inc                                       | 4 592 860        | 0,09              | 141 347 Prologis Inc   | 17 635 865           | 0,33              |
| 584 899 Wells Fargo & Co  | 21 863 525       | 0,41              | 24 239 Public Storage  | 7 323 571            | 0,14              |
| 11 500 West Pharmaceutical Services                               | 3 984 405        | 0,08              | 94 493 Realty Income   | 5 983 297            | 0,11              |
| 49 204 Western Digital Corp                                       | 1 853 515        | 0,03              | 24 198 Regency Centers Corp  | 1 480 434            | 0,03              |
| 28 453 Westinghouse Air Brake Technologies Corp                   | 2 875 460        | 0,05              | 16 414 SBA Communications Corp   | 4 285 203            | 0,08              |
| 38 009 Westrock Co  | 1 158 134        | 0,02              | 50 403 Simon Property Group  | 5 643 624            | 0,11              |
| 8 027 Whirlpool Corp  | 1 059 725        | 0,02              | 47 292 UDR Inc   | 1 941 810            | 0,04              |
| 185 152 Williams Cos Inc  | 5 528 639        | 0,10              | 61 291 Ventas Inc  | 2 656 965            | 0,05              |
| 16 701 Willis Towers Watson PLC                                   | 3 880 978        | 0,07              | 153 719 VICI Properties Inc  | 5 014 314            | 0,09              |
| 6 894 WW Grainger Inc   | 4 748 656        | 0,09              | 71 881 Welltower Inc   | 5 153 149            | 0,10              |
| 14 952 Wynn Resorts Ltd   | 1 673 278        | 0,03              | 114 642 Weyerhaeuser Co  | 3 454 163            | 0,07              |
| 81 935 Xcel Energy Inc  | 5 525 696        | 0,10              | <b>Total des fiducies de placement immobilier de type REIT</b>                     | <b>130 783 777</b>   | <b>2,47</b>       |
| 27 011 Xylem Inc/NY   | 2 828 052        | 0,05              | <b>Total des valeurs mobilières</b>  | <b>5 260 283 189</b> | <b>99,20</b>      |
| 42 978 Yum! Brands Inc  | 5 676 534        | 0,11              |  |                      |                   |
| 7 975 Zebra Technologies Corp                                     | 2 536 050        | 0,05              |  |                      |                   |

## SPDR S&P 500 UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

Instruments financiers dérivés – 0,21 % (mars 2022 : (0,07 %))

Contrats de change à terme – 0,19 % (mars 2022 : (0,07 %))^

| Devise achetée  | Devise vendue | Montant acheté | Montant vendu | Date d'échéance | Contrepartie                | Plus-values/ (Moins-values) latentes USD | % du Comp.    |
|---|---------------|----------------|---------------|-----------------|-----------------------------|--|---------------|
| EUR   | USD           | 108 474 298    | 115 265 657   | 04/04/2023      | HSBC Bank                   | 2 586 234                                | 0,05          |
| EUR   | USD           | 108 474 914    | 115 265 661   | 04/04/2023      | Westpac Banking Corporation | 2 586 900                                | 0,05          |
| EUR   | USD           | 108 476 238    | 115 265 657   | 04/04/2023      | Bank of Montreal            | 2 588 341                                | 0,05          |
| EUR   | USD           | 108 478 382    | 115 265 657   | 04/04/2023      | Toronto Dominion Bank       | 2 590 670                                | 0,05          |
| USD   | EUR           | 15 969 000     | 15 028 770    | 04/04/2023      | Bank of Montreal            | (359 006)                                | (0,01)        |
| USD   | EUR           | 5 194 000      | 4 856 787     | 04/04/2023      | Citibank                    | (82 656)                                 | (0,00)        |
| <b>Plus-values latentes sur contrats de change à terme</b>        |               |                |               |                 |                             | <b>10 352 145</b>                        | <b>0,20</b>   |
| <b>Moins-values latentes sur contrats de change à terme</b>       |               |                |               |                 |                             | <b>(441 662)</b>                         | <b>(0,01)</b> |
| <b>Plus-values latentes nettes sur contrats de change à terme</b> |               |                |               |                 |                             | <b>9 910 483</b>                         | <b>0,19</b>   |

Contrats à terme standardisés – 0,02 % (mars 2022 : 0,00 %)

| Montant notionnel  | Prix du coût moyen |  | Plus-values latentes USD | % des actifs nets |
|--|--------------------|--|--------------------------|-------------------|
| 24 088 528   | 3 949              | 122 of S&P 500 E-mini Index Futures Long Contracts Expiring 16 June 2023 | 1 151 747                | 0,02              |
| <b>Plus-values latentes nettes sur contrats à terme standardisés</b> |                    |  | <b>1 151 747</b>         | <b>0,02</b>       |
| <b>Total des instruments financiers dérivés</b>                      |                    |  | <b>11 062 230</b>        | <b>0,21</b>       |

|   | Juste valeur USD     | % du Comp.    |
|---|----------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | <b>5 271 345 419</b> | <b>99,41</b>  |
| Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,14 %)                                      | 27 862 338           | 0,53          |
| Liquidités détenues auprès d'un courtier* (mars 2022 : néant)                       | 566 928              | 0,01          |
| Montants à recevoir du courtier (mars 2022 : (0,00 %))                              | -                    | -             |
| Autres actifs nets (mars 2022 : 0,05 %)   | 2 856 543            | 0,05          |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>5 302 631 228</b> | <b>100,00</b> |

^ Les contrats à terme sont utilisés à des fins de couverture.

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company, à l'exception des liquidités détenues auprès d'un courtier, en l'occurrence Goldman Sachs.

Le courtier pour les contrats à terme standardisés ouverts est Goldman Sachs.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

| Analyse du total des actifs (non auditée)                               | % du total des actifs |
|---|-----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs | 99,07                 |
| Instruments financiers dérivés négociés en Bourse                       | 0,02                  |
| Instruments financiers dérivés négociés de gré à gré                    | 0,20                  |
| Autres actifs   | 0,71                  |
| <b>Total des actifs</b>   | <b>100,00</b>         |

## SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD        | 2022<br>USD        |
|--|-------|--------------------|--------------------|
| <b>Actifs circulants</b>   |       |                    |                    |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                         | 1(e)  |                    |                    |
| Valeurs mobilières   |       | 154 712 248        | 184 679 030        |
| Instruments financiers dérivés   |       | 9 108              | 13 841             |
|  |       | <b>154 721 356</b> | <b>184 692 871</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie  | 1(f)  | 183 272            | 286 147            |
| Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties à des instruments financiers ouverts | 1(g)  | 4 980              | -                  |
| Créances :   |       |                    |                    |
| Dividendes à recevoir  |       | 219 122            | 219 373            |
| À recevoir sur cessions d'investissements  |       | 6 741 618          | -                  |
| <b>Total des actifs circulants</b>   |       | <b>161 870 348</b> | <b>185 198 391</b> |
| <b>Passifs circulants</b>  |       |                    |                    |
| Liquidités dues aux courtiers et aux contreparties pour des instruments financiers ouverts       | 1(g)  | -                  | (5 104)            |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :   |       |                    |                    |
| Charges à payer  |       | (47 555)           | (52 647)           |
| À payer sur rachats d'actions de fonds   |       | (6 742 368)        | -                  |
| <b>Total des passifs circulants</b>  |       | <b>(6 789 923)</b> | <b>(57 751)</b>    |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>              |       | <b>155 080 425</b> | <b>185 140 640</b> |
|  |       | <b>2023</b>        | <b>2022</b>        |
|  |       | <b>2021</b>        |                    |
| Valeur liquidative par action  | 5     | 67,43 USD          | 71,21 USD          |
|  |       |                    | 60,84 USD          |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD        | 2022<br>USD       |
|--|-------|--------------------|-------------------|
| Produits de dividendes   |       | 4 575 109          | 4 156 091         |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat                 | 9     | (12 182 993)       | 27 500 113        |
| Produits divers  |       | 5 334              | 53                |
| <b>Total des (charges)/revenus d'investissement</b>  |       | <b>(7 602 550)</b> | <b>31 656 257</b> |
| Charges opérationnelles  | 3     | (600 990)          | (666 921)         |
| <b>(Perte)/Bénéfice net(te) pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(8 203 540)</b> | <b>30 989 336</b> |
| <b>(Perte)/Bénéfice pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(8 203 540)</b> | <b>30 989 336</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement  | 2     | (698 182)          | (632 596)         |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(8 901 722)</b> | <b>30 356 740</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | 2023<br>USD         | 2022<br>USD         |
|--|---------------------|---------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier                              | 185 140 640         | 206 872 889         |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(8 901 722)</b>  | <b>30 356 740</b>   |
| <b>Opérations sur actions</b>  |                     |                     |
| Produits sur actions de participation rachetables émises   | 111 627 203         | 102 977 290         |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables   | (132 785 696)       | (155 066 279)       |
| Diminution des actifs nets résultant d'opérations sur actions  | (21 158 493)        | (52 088 989)        |
| <b>Diminution totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                                  | <b>(30 060 215)</b> | <b>(21 732 249)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>                       | <b>155 080 425</b>  | <b>185 140 640</b>  |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.



## SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD         | 2022<br>USD         |
|--|-------|---------------------|---------------------|
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(8 901 722)</b>  | <b>30 356 740</b>   |
| <b>Ajustement pour :</b>   |       |                     |                     |
| Variation de la trésorerie détenue par/à payer au courtier   |       | (10 084)            | 21 924              |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat   |       | 23 225 164          | 46 042 590          |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés  |       | 4 733               | (7 814)             |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>  |       | <b>14 318 091</b>   | <b>76 413 440</b>   |
| Variation des montants à recevoir  |       | 251                 | 3 561               |
| Variation des montants à payer   |       | (5 092)             | (14 366)            |
| <b>Sorties de trésorerie sur opérations</b>  |       | <b>(4 841)</b>      | <b>(10 805)</b>     |
| <b>Entrées de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>   |       | <b>14 313 250</b>   | <b>76 402 635</b>   |
| <b>Activités de financement</b>  |       |                     |                     |
| Produits des souscriptions   | 5     | 111 627 203         | 102 977 290         |
| Paiements sur rachats  | 5     | (126 043 328)       | (179 403 405)       |
| <b>Trésorerie nette utilisée sur activités de financement</b>  |       | <b>(14 416 125)</b> | <b>(76 426 115)</b> |
| <b>Diminution nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>  |       | <b>(102 875)</b>    | <b>(23 480)</b>     |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier   |       | 286 147             | 309 627             |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>  |       | <b>183 272</b>      | <b>286 147</b>      |
| <b>Informations supplémentaires</b>  |       |                     |                     |
| Impôts payés   |       | (698 182)           | (632 596)           |
| Dividendes reçus   |       | 4 575 360           | 4 159 652           |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                              | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,76 % (mars 2022 : 99,75 %)</b> |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 98,75 % (mars 2022 : 90,28 %)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,75 %</b>                         |                  |                   |
| 12 895 Abbott Laboratories                                | 1 305 750        | 0,84              |
| 11 202 AbbVie Inc   | 1 785 265        | 1,15              |
| 22 407 Aflac Inc  | 1 445 703        | 0,93              |
| 28 705 Alliant Energy Corp                                | 1 532 851        | 0,99              |
| 31 793 Altria Group Inc                                   | 1 418 608        | 0,91              |
| 19 444 Ameren Corp  | 1 679 770        | 1,08              |
| 17 202 American Electric Power Co Inc                     | 1 565 212        | 1,01              |
| 10 114 AmerisourceBergen Corp                             | 1 619 354        | 1,04              |
| 10 338 AMETEK   | 1 502 423        | 0,97              |
| 7 043 Amgen Inc   | 1 702 647        | 1,10              |
| 7 242 Arthur J Gallagher & Co                             | 1 385 468        | 0,89              |
| 13 436 Atmos Energy Corp                                  | 1 509 671        | 0,97              |
| 6 117 Becton Dickinson and Co                             | 1 514 203        | 0,98              |
| 5 382 Berkshire Hathaway Inc                              | 1 661 801        | 1,07              |
| 25 737 Bristol-Myers Squibb Co                            | 1 783 835        | 1,15              |
| 22 480 Brown-Forman                                       | 1 444 793        | 0,93              |
| 30 520 Campbell Soup Co                                   | 1 677 994        | 1,08              |
| 17 658 Cardinal Health Inc                                | 1 333 181        | 0,86              |
| 11 825 Cboe Global Markets Inc                            | 1 587 390        | 1,02              |
| 54 199 CenterPoint Energy Inc                             | 1 596 709        | 1,03              |
| 7 471 Chubb Ltd   | 1 450 720        | 0,94              |
| 17 890 Church & Dwight Co Inc                             | 1 581 657        | 1,02              |
| 4 879 Cigna Group   | 1 246 732        | 0,80              |
| 7 927 CME Group Inc                                       | 1 518 180        | 0,98              |
| 25 753 CMS Energy Corp                                    | 1 580 722        | 1,02              |
| 31 072 Coca-Cola  | 1 927 400        | 1,24              |
| 23 816 Colgate-Palmolive                                  | 1 789 776        | 1,15              |
| 41 391 Conagra Brands Inc                                 | 1 554 651        | 1,00              |
| 18 419 Consolidated Edison Inc                            | 1 762 148        | 1,14              |
| 6 363 Constellation Brands Inc                            | 1 437 339        | 0,93              |
| 15 905 CVS Health Corp                                    | 1 181 903        | 0,76              |
| 26 164 Dominion Energy Inc                                | 1 462 833        | 0,94              |
| 14 438 DTE Energy Co                                      | 1 581 541        | 1,02              |
| 17 144 Duke Energy Corp                                   | 1 653 884        | 1,07              |
| 12 992 Electronic Arts Inc                                | 1 564 888        | 1,01              |
| 14 002 Entergy Corp                                       | 1 508 578        | 0,97              |
| 25 799 Evergy Inc   | 1 576 838        | 1,02              |
| 19 384 Eversource Energy                                  | 1 516 994        | 0,98              |
| 35 352 Exelon Corp  | 1 480 900        | 0,95              |
| 39 427 FirstEnergy Corp                                   | 1 579 450        | 1,02              |
| 6 732 General Dynamics Corp                               | 1 536 311        | 0,99              |
| 21 270 General Mills Inc                                  | 1 817 737        | 1,17              |
| 9 054 Genuine Parts Co                                    | 1 514 826        | 0,98              |
| 16 959 Gilead Sciences Inc                                | 1 407 091        | 0,91              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,76 % (mars 2022 : 99,75 %)</b>         |                  |                   |
| <b>(suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 98,75 % (mars 2022 : 90,28 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 98,75 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 12 490 Globe Life Inc   | 1 374 152        | 0,89              |
| 18 782 Hartford Financial Services Group Inc                      | 1 308 920        | 0,84              |
| 16 467 Henry Schein Inc   | 1 342 721        | 0,87              |
| 7 315 Hershey Co  | 1 861 011        | 1,20              |
| 16 400 Hologic  | 1 323 482        | 0,85              |
| 7 219 Honeywell International Inc                                 | 1 379 697        | 0,89              |
| 38 769 Hormel Foods Corp  | 1 546 112        | 1,00              |
| 2 880 Humana  | 1 398 126        | 0,90              |
| 6 334 IDEX Corp   | 1 463 345        | 0,94              |
| 5 889 Illinois Tool Works Inc                                     | 1 433 678        | 0,92              |
| 17 692 Incyte Corp  | 1 278 603        | 0,82              |
| 11 436 International Business Machines Corp                       | 1 499 147        | 0,97              |
| 10 556 J M Smucker Co   | 1 661 199        | 1,07              |
| 9 319 Jack Henry & Associates Inc                                 | 1 404 561        | 0,91              |
| 12 818 Johnson & Johnson  | 1 986 792        | 1,28              |
| 24 567 Kellogg Co   | 1 645 010        | 1,06              |
| 50 318 Keurig Dr Pepper Inc                                       | 1 775 225        | 1,14              |
| 12 969 Kimberly-Clark Corp  | 1 740 701        | 1,12              |
| 35 903 Kraft Heinz Co   | 1 388 373        | 0,90              |
| 15 377 Leidos Holdings Inc  | 1 415 609        | 0,91              |
| 3 003 Lockheed Martin Corp  | 1 419 609        | 0,92              |
| 25 532 Loews Corp   | 1 481 370        | 0,96              |
| 8 432 Marsh & McLennan Cos Inc                                    | 1 404 351        | 0,91              |
| 19 076 McCormick & Co Inc/MID                                     | 1 587 317        | 1,02              |
| 7 000 McDonald's Corp   | 1 957 271        | 1,26              |
| 4 251 McKesson Corp   | 1 513 570        | 0,98              |
| 16 530 Medtronic PLC  | 1 332 651        | 0,86              |
| 17 275 Merck & Co Inc   | 1 837 890        | 1,19              |
| 20 658 MetLife Inc  | 1 196 927        | 0,77              |
| 27 160 Mondelez International Inc                                 | 1 893 599        | 1,22              |
| 56 040 NiSource Inc   | 1 566 885        | 1,01              |
| 16 692 Otis Worldwide Corp  | 1 408 807        | 0,91              |
| 10 996 PepsiCo  | 2 004 573        | 1,29              |
| 14 554 Philip Morris International Inc                            | 1 415 379        | 0,91              |
| 20 305 Pinnacle West Capital Corp                                 | 1 608 971        | 1,04              |
| 54 520 PPL Corp   | 1 515 117        | 0,98              |
| 12 130 Procter & Gamble Co  | 1 803 612        | 1,16              |
| 10 305 Progressive  | 1 474 235        | 0,95              |
| 25 281 Public Service Enterprise Group Inc                        | 1 578 802        | 1,02              |
| 10 689 Quest Diagnostics  | 1 512 281        | 0,98              |
| 14 549 Raytheon Technologies Corp                                 | 1 424 786        | 0,92              |
| 13 199 Republic Services Inc                                      | 1 784 771        | 1,15              |
| 3 348 Roper Technologies  | 1 475 431        | 0,95              |

## SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|--|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,76 % (mars 2022 : 99,75 %) (suite)</b>                  |                    |                   |
| <b>Actions ordinaires – 98,75 % (mars 2022 : 90,28 %) (suite)</b>                  |                    |                   |
| <b>Dollar américain – 98,75 % (suite)</b>  |                    |                   |
| 10 034 Sempra Energy   | 1 516 741          | 0,98              |
| 5 649 Snap-on  | 1 394 683          | 0,90              |
| 24 027 Southern Co   | 1 671 802          | 1,08              |
| 8 568 Travelers Cos Inc  | 1 468 642          | 0,95              |
| 3 137 UnitedHealth Group Inc   | 1 482 516          | 0,96              |
| 39 731 Verizon Communications Inc  | 1 545 143          | 1,00              |
| 21 748 W. R. Berkley   | 1 354 033          | 0,87              |
| 11 190 Waste Management Inc  | 1 825 874          | 1,18              |
| 17 410 WEC Energy Group Inc  | 1 650 296          | 1,06              |
| 5 883 Willis Towers Watson PLC   | 1 367 093          | 0,88              |
| 23 404 Xcel Energy Inc   | 1 578 369          | 1,02              |
| 11 948 Yum! Brands Inc   | 1 578 094          | 1,02              |
| <b>Total des actions ordinaires</b>  | <b>153 143 682</b> | <b>98,75</b>      |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 1,01 % (mars 2022 : 9,47 %)</b> |                    |                   |
| <b>Dollar américain – 1,01 %</b>   |                    |                   |
| 24 772 Realty Income   | 1 568 566          | 1,01              |
| <b>Total des fiducies de placement immobilier de type REIT</b>                     | <b>1 568 566</b>   | <b>1,01</b>       |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>  | <b>154 712 248</b> | <b>99,76</b>      |
| <b>Instruments financiers dérivés – 0,01 % (mars 2022 : 0,01 %)</b>                |                    |                   |
| <b>Contrats à terme standardisés – 0,01 % (mars 2022 : 0,01 %)</b>                 |                    |                   |

| Montant notionnel | Prix du coût moyen | Plus-values latentes USD   | % des actifs nets |
|-------------------|--------------------|--|-------------------|
| 197 780           | 3 956              | 1 of S&P 500 E-mini Index Futures Long Contracts Expiring 16 June 2023 | 0,01              |
|                   |                    | 9 108  | 0,01              |
|                   |                    | <b>9 108</b>   | <b>0,01</b>       |
|                   |                    | <b>9 108</b>   | <b>0,01</b>       |

|   | Juste valeur USD   | % du Comp.    |
|---|--------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | <b>154 721 356</b> | <b>99,77</b>  |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,15 %)</b>                               | <b>183 272</b>     | <b>0,12</b>   |
| <b>Liquidités détenues auprès d'un courtier* (mars 2022 : néant)</b>                | <b>4 980</b>       | <b>0,00</b>   |
| <b>Montants à recevoir du courtier (mars 2022 : (0,00 %))</b>                       | <b>-</b>           | <b>-</b>      |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : 0,09 %)</b>                                      | <b>170 817</b>     | <b>0,11</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>155 080 425</b> | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company, à l'exception des liquidités détenues auprès d'un courtier, en l'occurrence Goldman Sachs.

Le courtier pour les contrats à terme standardisés ouverts est Goldman Sachs.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

|   | % du total des actifs |
|---|-----------------------|
| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                        |                       |
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs | 95,57                 |
| Instruments financiers dérivés négociés en Bourse                       | 0,01                  |
| Autres actifs   | 4,42                  |
| <b>Total des actifs</b>   | <b>100,00</b>         |

## SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD        | 2022<br>USD        |
|--|-------|--------------------|--------------------|
| <b>Actifs circulants</b>   |       |                    |                    |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                   | 1(e)  |                    |                    |
| Valeurs mobilières   |       | 127 454 679        | 101 262 726        |
| Instruments financiers dérivés   |       | 49 444             | 51 900             |
|  |       | <b>127 504 123</b> | <b>101 314 626</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie  | 1(f)  | 543 729            | 895 921            |
| Créances :   |       |                    |                    |
| Dividendes à recevoir  |       | 1 155 910          | 683 748            |
| <b>Total des actifs circulants</b>   |       | <b>129 203 762</b> | <b>102 894 295</b> |
| <b>Passifs circulants</b>  |       |                    |                    |
| Liquidités dues aux courtiers et aux contreparties pour des instruments financiers ouverts | 1(g)  | (1 394)            | (4 355)            |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :   |       |                    |                    |
| Charges à payer  |       | (59 745)           | (46 004)           |
| À payer sur achats d'investissements   |       | -                  | (604 234)          |
| <b>Total des passifs circulants</b>  |       | <b>(61 139)</b>    | <b>(654 593)</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>        |       | <b>129 142 623</b> | <b>102 239 702</b> |
|  |       | <b>2023</b>        | <b>2022</b>        |
|  |       | <b>2021</b>        |                    |
| Valeur liquidative par action  | 5     | 13,31 USD          | 14,61 USD          |
|  |       |                    | 16,02 USD          |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD         | 2022<br>USD         |
|---|-------|---------------------|---------------------|
| Produits de dividendes  |       | 5 800 819           | 5 944 218           |
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 57                  | 2 485               |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 9     | (11 368 240)        | (10 463 198)        |
| <b>Total des charges d'investissement</b>   |       | <b>(5 567 364)</b>  | <b>(4 516 495)</b>  |
| Charges opérationnelles   | 3     | (738 662)           | (654 089)           |
| <b>Perte nette pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(6 306 026)</b>  | <b>(5 170 584)</b>  |
| <b>Charges financières</b>  |       |                     |                     |
| Charges d'intérêts  |       | (514)               | (6 106)             |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables   | 7     | (5 484 930)         | (4 697 190)         |
| <b>Perte pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(11 791 470)</b> | <b>(9 873 880)</b>  |
| Impôt sur les plus-values de capital  | 2     | 9 071               | -                   |
| Retenue à la source sur produits d'investissement   | 2     | (598 256)           | (381 119)           |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(12 380 655)</b> | <b>(10 254 999)</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>USD         | 2022<br>USD         |
|---|---------------------|---------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier               | 102 239 702         | 150 563 497         |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(12 380 655)</b> | <b>(10 254 999)</b> |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                     |                     |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 49 287 935          | 4 194 532           |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (10 004 359)        | (42 263 328)        |
| Augmentation/(Diminution) des actifs nets résultant d'opérations sur actions  | 39 283 576          | (38 068 796)        |
| <b>Augmentation/(Diminution) totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>    | <b>26 902 921</b>   | <b>(48 323 795)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>        | <b>129 142 623</b>  | <b>102 239 702</b>  |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD         | 2022<br>USD         |
|---|-------|---------------------|---------------------|
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(12 380 655)</b> | <b>(10 254 999)</b> |
| <b>Ajustement pour :</b>  |       |                     |                     |
| Variation de la trésorerie détenue par/à payer au courtier  |       | (2 961)             | 168 953             |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  |       | (26 796 187)        | 47 791 117          |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés   |       | 2 456               | (72 040)            |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   |       | <b>(39 177 347)</b> | <b>37 633 031</b>   |
| Variation des montants à recevoir   |       | (472 162)           | 633 195             |
| Variation des montants à payer  |       | 13 741              | (26 153)            |
| <b>(Sorties)/Entrées de trésorerie sur opérations</b>   |       | <b>(458 421)</b>    | <b>607 042</b>      |
| <b>(Sorties)/Entrées de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  |       | <b>(39 635 768)</b> | <b>38 240 073</b>   |
| <b>Activités de financement</b>   |       |                     |                     |
| Produits des souscriptions  | 5     | 49 287 935          | 4 194 532           |
| Paiements sur rachats   | 5     | (10 004 359)        | (42 263 328)        |
| <b>Trésorerie nette générée/(utilisée) sur activités de financement</b>   |       | <b>39 283 576</b>   | <b>(38 068 796)</b> |
| <b>(Diminution)/Augmentation nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>                                    |       | <b>(352 192)</b>    | <b>171 277</b>      |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  |       | 895 921             | 724 644             |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   |       | <b>543 729</b>      | <b>895 921</b>      |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |       |                     |                     |
| Impôts payés  |       | (589 185)           | (381 119)           |
| Intérêts reçus  |       | 57                  | 2 485               |
| Intérêts payés  |       | (514)               | (6 106)             |
| Dividendes reçus  |       | 5 328 657           | 6 577 413           |
| Distributions payées  |       | (5 484 930)         | (4 697 190)         |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                              | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,69 % (mars 2022 : 99,05 %)</b> |                   |                   |
| <b>Actions ordinaires – 98,69 % (mars 2022 : 97,89 %)</b> |                   |                   |
| <b>Dollar de Hong Kong – 39,45 %</b>                      |                   |                   |
| 306 500 Beijing Enterprises Holdings Ltd                  | 1 103 016         | 0,85              |
| 3 942 000 Bosideng International Holdings Ltd             | 2 199 499         | 1,70              |
| 877 000 China Conch Venture Holdings Ltd                  | 1 530 570         | 1,19              |
| 6 090 000 China Construction Bank Corp                    | 3 948 828         | 3,06              |
| 1 441 200 China Gas Holdings Ltd                          | 2 030 544         | 1,57              |
| 290 000 China Merchants Bank Co Ltd                       | 1 481 411         | 1,15              |
| 4 521 000 China Railway Group Ltd (Class H)               | 2 758 691         | 2,14              |
| 466 400 China Resources Gas Group Ltd                     | 1 720 047         | 1,33              |
| 3 225 000 China Suntien Green Energy Corp Ltd             | 1 409 149         | 1,09              |
| 744 400 China Taiping Insurance Holdings Co Ltd           | 790 871           | 0,61              |
| 803 000 Far East Horizon Ltd                              | 722 193           | 0,56              |
| 1 364 500 Greentown China Holdings Ltd                    | 1 769 516         | 1,37              |
| 1 907 000 Guangdong Investment Ltd                        | 1 950 740         | 1,51              |
| 3 434 000 Lenovo Group Ltd                                | 3 718 368         | 2,88              |
| 1 062 500 Longfor Group Holdings Ltd                      | 2 998 029         | 2,32              |
| 938 000 New China Life Insurance Co Ltd                   | 2 229 706         | 1,73              |
| 6 502 000 People's Insurance Co Group of China Ltd        | 2 170 108         | 1,68              |
| 8 678 000 PetroChina Co Ltd                               | 5 140 504         | 3,98              |
| 320 000 Ping An Insurance Group Co of China Ltd           | 2 083 071         | 1,61              |
| 3 951 000 Postal Savings Bank of China Co Ltd             | 2 345 449         | 1,82              |
| 1 326 000 Yankuang Energy Group Co Ltd                    | 4 746 603         | 3,68              |
| 1 390 000 Yuexiu Property Co Ltd                          | 2 096 523         | 1,62              |
|   | <b>50 943 436</b> | <b>39,45</b>      |
| <b>Ringgit malais – 0,43 %</b>                            |                   |                   |
| 150 100 Petronas Gas Bhd                                  | 560 600           | 0,43              |
|   | <b>560 600</b>    | <b>0,43</b>       |
| <b>Peso mexicain – 4,34 %</b>                             |                   |                   |
| 474 394 Arca Continental SAB de CV                        | 4 299 393         | 3,33              |
| 602 719 Orbia Advance Corp SAB de CV                      | 1 307 849         | 1,01              |
|   | <b>5 607 242</b>  | <b>4,34</b>       |
| <b>Nouveau dollar de Taiwan – 25,95 %</b>                 |                   |                   |
| 259 000 International Games System Co Ltd                 | 4 865 687         | 3,77              |
| 123 000 Parade Technologies Ltd                           | 4 241 728         | 3,28              |
| 457 000 Radiant Opto-Electronics Corp                     | 1 658 544         | 1,28              |
| 655 000 Realtek Semiconductor Corp                        | 8 336 070         | 6,45              |
| 5 794 048 SinoPac Financial Holdings Co Ltd               | 3 158 919         | 2,45              |
| 1 362 000 Vanguard International Semiconductor Corp       | 4 334 602         | 3,36              |
| 2 412 000 Wistron Corp                                    | 3 315 287         | 2,57              |
| 962 000 Zhen Ding Technology Holding Ltd                  | 3 601 872         | 2,79              |
|   | <b>33 512 709</b> | <b>25,95</b>      |
| <b>Peso philippin – 0,55 %</b>                            |                   |                   |
| 1 194 400 Semirara Mining & Power Corp                    | 710 730           | 0,55              |
|   | <b>710 730</b>    | <b>0,55</b>       |

| Participation Investissement  | Juste valeur USD          | % des actifs nets  |                          |             |
|---|---------------------------|--|--------------------------|-------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,69 % (mars 2022 : 99,05 %)</b>           |                           |  |                          |             |
| <b>(suite)</b>  |                           |  |                          |             |
| <b>Actions ordinaires – 98,69 % (mars 2022 : 97,89 %) (suite)</b>   |                           |  |                          |             |
| <b>Riyal saoudien – 5,20 %</b>                                      |                           |  |                          |             |
| 144 668 Advanced Petrochemical Co                                   | 1 842 217                 | 1,43   |                          |             |
| 456 710 Saudi Telecom Co  | 4 872 855                 | 3,77   |                          |             |
|   | <b>6 715 072</b>          | <b>5,20</b>  |                          |             |
| <b>Won sud-coréen – 18,16 %</b>                                     |                           |  |                          |             |
| 67 412 Cheil Worldwide Inc  | 964 175                   | 0,75   |                          |             |
| 199 838 GS Engineering & Construction Corp                          | 3 169 839                 | 2,45   |                          |             |
| 38 588 GS Holdings Corp   | 1 197 492                 | 0,93   |                          |             |
| 11 057 KIWOOM Securities Co Ltd                                     | 857 823                   | 0,66   |                          |             |
| 42 956 KT&G Corp  | 2 768 375                 | 2,14   |                          |             |
| 17 291 Kumho Petrochemical Co Ltd                                   | 1 908 604                 | 1,48   |                          |             |
| 196 759 LG Uplus Corp   | 1 636 825                 | 1,27   |                          |             |
| 13 564 S-1 Corp   | 576 172                   | 0,45   |                          |             |
| 16 381 Samsung Card Co Ltd  | 382 519                   | 0,30   |                          |             |
| 132 273 Shinhan Financial Group Co Ltd                              | 3 591 697                 | 2,78   |                          |             |
| 16 916 SK Inc   | 2 241 433                 | 1,73   |                          |             |
| 474 578 Woori Financial Group Inc                                   | 4 159 415                 | 3,22   |                          |             |
|   | <b>23 454 369</b>         | <b>18,16</b>   |                          |             |
| <b>Lire turque – 3,34 %</b>   |                           |  |                          |             |
| 443 409 Tofas Turk Otomobil Fabrikasi AS                            | 4 312 814                 | 3,34   |                          |             |
|   | <b>4 312 814</b>          | <b>3,34</b>  |                          |             |
| <b>Dollar américain – 1,27 %</b>                                    |                           |  |                          |             |
| 174 039 Costamare Inc   | 1 637 707                 | 1,27   |                          |             |
|   | <b>1 637 707</b>          | <b>1,27</b>  |                          |             |
| <b>Total des actions ordinaires</b>                                 | <b>127 454 679</b>        | <b>98,69</b>   |                          |             |
| <b>Certificats de dépôt – néant (mars 2022 : 1,16 %)</b>            |                           |  |                          |             |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>                                 | <b>127 454 679</b>        | <b>98,69</b>   |                          |             |
| <b>Instruments financiers dérivés – 0,04 % (mars 2022 : 0,05 %)</b> |                           |  |                          |             |
| <b>Contrats à terme standardisés – 0,04 % (mars 2022 : 0,05 %)</b>  |                           |  |                          |             |
| <b>Montant notionnel</b>  | <b>Prix du coût moyen</b> | <b>Plus-values latentes USD</b>                                      | <b>% des actifs nets</b> |             |
| 1 493 581   | 964                       | 31 of MSCI Emerging Markets Index Futures Expiring 16 June 2023      | 49 444                   | 0,04        |
|   |                           | <b>Plus-values latentes nettes sur contrats à terme standardisés</b> | <b>49 444</b>            | <b>0,04</b> |
|   |                           | <b>Total des instruments financiers dérivés</b>                      | <b>49 444</b>            | <b>0,04</b> |



## SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

|   | Juste valeur<br>USD       | % du<br>Comp.        |
|---|---------------------------|----------------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | 127 504 123               | 98,73                |
| <b>Disponibilités bancaires*</b><br>(mars 2022 : 0,88 %)                                | 543 729                   | 0,42                 |
| <b>Montants à recevoir du courtier*</b><br>(mars 2022 : (0,00 %))                       | (1 394)                   | (0,00)               |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : 0,02 %)</b>  | <u>1 096 165</u>          | <u>0,85</u>          |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs<br/>d'actions de participation rachetables</b> | <u><b>129 142 623</b></u> | <u><b>100,00</b></u> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company, à l'exception des montants à payer aux courtiers qui sont détenus auprès de Goldman Sachs.

Le courtier pour les contrats à terme standardisés ouverts est Goldman Sachs.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

|   | % du<br>total<br>des actifs |
|---|-----------------------------|
| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                        |                             |
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs | 98,64                       |
| Instruments financiers dérivés négociés en Bourse                       | 0,04                        |
| Autres actifs   | <u>1,32</u>                 |
| <b>Total des actifs</b>   | <u><b>100,00</b></u>        |

## SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>EUR          | 2022<br>EUR          |
|--|-------|----------------------|----------------------|
| <b>Actifs circulants</b>   |       |                      |                      |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                         |       |                      |                      |
|  | 1(e)  |                      |                      |
| Valeurs mobilières   |       | 1 207 219 538        | 1 077 481 752        |
| Instruments financiers dérivés   |       | 463 626              | 161 217              |
|  |       | <b>1 207 683 164</b> | <b>1 077 642 969</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie  | 1(f)  | 9 300 041            | 3 152 458            |
| Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties à des instruments financiers ouverts | 1(g)  | 341 417              | 622 360              |
| Créances :   |       |                      |                      |
| Dividendes à recevoir  |       | 7 251 667            | 12 731 761           |
| À recevoir sur cessions d'investissements  |       | 14 017 471           | -                    |
| <b>Total des actifs circulants</b>   |       | <b>1 238 593 760</b> | <b>1 094 149 548</b> |
| <b>Passifs circulants</b>  |       |                      |                      |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :   |       |                      |                      |
| Charges à payer  |       | (288 342)            | (288 694)            |
| À payer sur achats d'investissements   |       | (21 159 926)         | -                    |
| <b>Total des passifs circulants</b>  |       | <b>(21 448 268)</b>  | <b>(288 694)</b>     |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>              |       | <b>1 217 145 492</b> | <b>1 093 860 854</b> |
|  |       | <b>2023</b>          | <b>2022</b>          |
|  |       | <b>2021</b>          |                      |
| Valeur liquidative par action  | 5     | 21,62 EUR            | 21,53 EUR            |
|  |       |                      | 22,32 EUR            |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>EUR        | 2022<br>EUR         |
|---|-------|--------------------|---------------------|
| Produits de dividendes  |       | 38 866 052         | 49 617 950          |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 9     | 4 075 411          | (49 944 272)        |
| Produits divers   |       | -                  | 1 047 066           |
| <b>Total des produits d'investissement</b>  |       | <b>42 941 463</b>  | <b>720 744</b>      |
| Charges opérationnelles   | 3     | (3 135 558)        | (4 378 414)         |
| <b>Bénéfice/(Perte) net(te) pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>                               |       | <b>39 805 905</b>  | <b>(3 657 670)</b>  |
| <b>Charges financières</b>  |       |                    |                     |
| Charges d'intérêts  |       | (30 805)           | (85 593)            |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables   | 7     | (39 102 340)       | (43 662 000)        |
| <b>Bénéfice/(Perte) pour l'exercice financier avant impôt</b>   |       | <b>672 760</b>     | <b>(47 405 263)</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement   | 2     | (2 940 495)        | (3 052 699)         |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(2 267 735)</b> | <b>(50 457 962)</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>EUR          | 2022<br>EUR          |
|---|----------------------|----------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier               | 1 093 860 854        | 1 491 082 538        |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(2 267 735)</b>   | <b>(50 457 962)</b>  |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                      |                      |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 315 680 023          | 369 948 586          |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (190 127 650)        | (716 712 308)        |
| Augmentation/(Diminution) des actifs nets résultant d'opérations sur actions  | 125 552 373          | (346 763 722)        |
| <b>Augmentation/(Diminution) totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>    | <b>123 284 638</b>   | <b>(397 221 684)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>        | <b>1 217 145 492</b> | <b>1 093 860 854</b> |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

| Notes   | 2023<br>EUR          | 2022<br>EUR          |
|---|----------------------|----------------------|
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(2 267 735)</b>   | <b>(50 457 962)</b>  |
| <b>Ajustement pour :</b>  |                      |                      |
| Variation de la trésorerie détenue par/à payer au courtier  | 280 943              | (486 114)            |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | (122 595 331)        | 401 382 575          |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés   | (302 409)            | (125 191)            |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   | <b>(124 884 532)</b> | <b>350 313 308</b>   |
| Variation des montants à recevoir   | 5 480 094            | (1 302 976)          |
| Variation des montants à payer  | (352)                | (67 143)             |
| <b>Entrées/(Sorties) de trésorerie sur opérations</b>   | <b>5 479 742</b>     | <b>(1 370 119)</b>   |
| <b>(Sorties)/Entrées de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  | <b>(119 404 790)</b> | <b>348 943 189</b>   |
| <b>Activités de financement</b>   |                      |                      |
| Produits des souscriptions  | 5 315 680 023        | 369 948 586          |
| Paiements sur rachats   | 5 (190 127 650)      | (716 712 308)        |
| <b>Trésorerie nette générée/(utilisée) sur activités de financement</b>   | <b>125 552 373</b>   | <b>(346 763 722)</b> |
| <b>Augmentation nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>   | <b>6 147 583</b>     | <b>2 179 467</b>     |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  | 3 152 458            | 972 991              |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   | <b>9 300 041</b>     | <b>3 152 458</b>     |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |                      |                      |
| Impôts payés  | (2 940 495)          | (3 052 699)          |
| Intérêts payés  | (30 805)             | (85 593)             |
| Dividendes reçus  | 44 346 146           | 48 314 974           |
| Distributions payées  | (39 102 340)         | (43 662 000)         |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                                      | Juste valeur<br>EUR  | % des<br>actifs<br>nets |
|---|----------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,18 % (mars 2022 : 98,50 %)</b>         |                      |                         |
| <b>Actions ordinaires – 96,02 % (mars 2022 : 97,55 %)</b>         |                      |                         |
| <b>Euro – 96,02 %</b>   |                      |                         |
| 1 066 483 Ageas SA/NV   | 42 510 027           | 3,49                    |
| 151 590 Air Liquide SA  | 23 375 178           | 1,92                    |
| 220 634 Allianz SE  | 46 950 915           | 3,86                    |
| 986 273 BASF SE   | 47 696 162           | 3,92                    |
| 1 860 380 Bouygues SA   | 57 840 048           | 4,75                    |
| 214 517 Brenntag SE   | 14 844 576           | 1,22                    |
| 1 106 692 Buzzi Unicem SpA  | 24 745 825           | 2,03                    |
| 277 062 CANCOM SE   | 8 727 464            | 0,72                    |
| 863 361 CRH PLC   | 40 124 703           | 3,30                    |
| 974 159 Deutsche Post AG  | 41 976 511           | 3,45                    |
| 9 740 434 EDP - Energias de Portugal                              | 48 858 068           | 4,01                    |
| 851 601 Elisa Oyj   | 47 314 998           | 3,89                    |
| 2 756 764 Enagas SA   | 48 794 866           | 4,01                    |
| 461 926 ERG SpA   | 12 915 550           | 1,06                    |
| 771 694 Fresenius SE & Co KGaA                                    | 19 176 596           | 1,57                    |
| 480 712 GEA Group AG  | 20 165 868           | 1,66                    |
| 201 327 Gerresheimer AG   | 18 350 980           | 1,51                    |
| 1 039 065 Glanbia PLC   | 13 882 825           | 1,14                    |
| 159 510 Hannover Rueck SE   | 28 767 629           | 2,36                    |
| 323 413 Henkel AG & Co KGaA (Voting rights)                       | 21 668 671           | 1,78                    |
| 8 295 102 Hera SpA  | 21 584 022           | 1,77                    |
| 689 997 Huhtamaki Oyj   | 23 597 928           | 1,94                    |
| 939 828 Kone Oyj  | 45 111 744           | 3,71                    |
| 122 451 Koninklijke DSM NV  | 13 260 260           | 1,09                    |
| 864 089 Koninklijke Vopak NV                                      | 28 074 288           | 2,31                    |
| 294 932 Legrand SA  | 24 798 284           | 2,04                    |
| 145 112 Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 46 798 623           | 3,84                    |
| 765 353 Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA            | 29 818 383           | 2,45                    |
| 552 192 Rubis SCA   | 13 623 274           | 1,12                    |
| 393 620 Sanofi  | 39 456 469           | 3,24                    |
| 166 735 SAP SE  | 19 351 264           | 1,59                    |
| 200 552 Schneider Electric SE (France listing)                    | 30 820 883           | 2,53                    |
| 1 093 834 Smurfit Kappa Group PLC                                 | 36 457 487           | 2,99                    |
| 550 845 Solvay SA   | 58 031 554           | 4,77                    |
| 1 391 704 UPM-Kymmene Oyj   | 43 073 262           | 3,54                    |
| 154 104 Wendel SE   | 15 002 024           | 1,23                    |
| 758 224 Wienerberger AG   | 20 199 113           | 1,66                    |
| 266 631 Wolters Kluwer NV   | 31 022 517           | 2,55                    |
| <b>Total des actions ordinaires</b>                               | <b>1 168 768 839</b> | <b>96,02</b>            |

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>EUR  | % des<br>actifs<br>nets |
|---|----------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,18 % (mars 2022 : 98,50 %)</b>                         |                      |                         |
| <b>(suite)</b>  |                      |                         |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 1,83 % (mars 2022 : néant)</b> |                      |                         |
| <b>Euro – 1,83 %</b>  |                      |                         |
| 815 500 Warehouses De Pauw CVA  | 22 279 460           | 1,83                    |
| <b>Total des fiducies de placement immobilier de type REIT</b>                    | <b>22 279 460</b>    | <b>1,83</b>             |
| <b>Actions préférentielles – 1,33 % (mars 2022 : 0,95 %)</b>                      |                      |                         |
| <b>Euro – 1,33 %</b>  |                      |                         |
| 430 773 Fuchs Petrolub SE   | 16 171 239           | 1,33                    |
| <b>Total des actions préférentielles</b>  | <b>16 171 239</b>    | <b>1,33</b>             |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>   | <b>1 207 219 538</b> | <b>99,18</b>            |

**Instruments financiers dérivés – 0,04 % (mars 2022 : 0,02 %)**

**Contrats à terme standardisés – 0,04 % (mars 2022 : 0,02 %)**

| Montant notionnel  | Prix du coût moyen | Plus-values latentes EUR  | % des actifs nets |
|--|--------------------|---|-------------------|
| 8 569 694  | 4 042              | 212 of Euro STOXX 50 Index Futures Long Futures Contracts Expiring 16 June 2023 | 0,04              |
|  |                    | 463 626   | 0,04              |
| <b>Plus-values latentes nettes sur contrats à terme standardisés</b> |                    | <b>463 626</b>  | <b>0,04</b>       |
| <b>Total des instruments financiers dérivés</b>                      |                    | <b>463 626</b>  | <b>0,04</b>       |

|   | Juste valeur<br>EUR  | % du<br>Comp. |
|---|----------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | <b>1 207 683 164</b> | <b>99,22</b>  |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,29 %)</b>                               | <b>9 300 041</b>     | <b>0,76</b>   |
| <b>Liquidités détenues auprès d'un courtier* (mars 2022 : 0,06 %)</b>               | <b>341 417</b>       | <b>0,03</b>   |
| <b>Autres passifs nets (mars 2022 : 1,13 %)</b>                                     | <b>(179 130)</b>     | <b>(0,01)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>1 217 145 492</b> | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company, à l'exception des liquidités détenues auprès d'un courtier, en l'occurrence Goldman Sachs.

Le courtier pour les contrats à terme standardisés ouverts est Goldman Sachs.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

## SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                        | <b>% du total des actifs</b> |
|---|------------------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs | 97,46                        |
| Instruments financiers dérivés négociés en Bourse                       | 0,04                         |
| Autres actifs   | 2,50                         |
| <b>Total des actifs</b>   | <b>100,00</b>                |

## SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|--|-------|----------------------|----------------------|
| <b>Actifs circulants</b>   |       |                      |                      |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                         | 1(e)  |                      |                      |
| Valeurs mobilières   |       | 1 177 281 048        | 1 192 798 115        |
| Instruments financiers dérivés   |       | 219 473              | 429 091              |
|  |       | <b>1 177 500 521</b> | <b>1 193 227 206</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie  | 1(f)  | 3 963 005            | 8 361 391            |
| Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties à des instruments financiers ouverts | 1(g)  | 272 033              | 40 127               |
| Créances :   |       |                      |                      |
| Dividendes à recevoir  |       | 7 607 184            | 5 472 486            |
| À recevoir sur cessions d'investissements  |       | 36 115 012           | 27 440 692           |
| <b>Total des actifs circulants</b>   |       | <b>1 225 457 755</b> | <b>1 234 541 902</b> |
| <b>Passifs circulants</b>  |       |                      |                      |
| Liquidités dues aux courtiers et aux contreparties pour des instruments financiers ouverts       | 1(g)  | -                    | (95 270)             |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :   |       |                      |                      |
| Charges à payer  |       | (450 764)            | (469 573)            |
| À payer sur achats d'investissements   |       | (36 558 940)         | (28 265 287)         |
| <b>Total des passifs circulants</b>  |       | <b>(37 009 704)</b>  | <b>(28 830 130)</b>  |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>              |       | <b>1 188 448 051</b> | <b>1 205 711 772</b> |
|  |       | <b>2023</b>          | <b>2022</b>          |
|  |       | <b>2021</b>          |                      |
| Valeur liquidative par action  | 5     | 30,32 USD            | 35,15 USD            |
|  |       |                      | 33,96 USD            |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.



## SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD       |
|--|-------|----------------------|-------------------|
| Produits de dividendes   |       | 70 809 623           | 42 445 550        |
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur   |       | 9 229                | 453               |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat                 | 9     | (196 743 227)        | 24 630 313        |
| Produits divers  |       | 16 990               | -                 |
| <b>Total des (charges)/revenus d'investissement</b>  |       | <b>(125 907 385)</b> | <b>67 076 316</b> |
| Charges opérationnelles  | 3     | (5 688 768)          | (4 050 158)       |
| <b>(Perte)/Bénéfice net(te) pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(131 596 153)</b> | <b>63 026 158</b> |
| <b>Charges financières</b>   |       |                      |                   |
| Charges d'intérêts   |       | -                    | (10 014)          |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables  | 7     | (54 995 675)         | (33 324 630)      |
| <b>(Perte)/Bénéfice pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(186 591 828)</b> | <b>29 691 514</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement  | 2     | (9 272 935)          | (5 569 928)       |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(195 864 763)</b> | <b>24 121 586</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|--|----------------------|----------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier                              | 1 205 711 772        | 716 525 350          |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(195 864 763)</b> | <b>24 121 586</b>    |
| <b>Opérations sur actions</b>  |                      |                      |
| Produits sur actions de participation rachetables émises   | 539 424 920          | 669 375 576          |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables   | (360 823 878)        | (204 310 740)        |
| Augmentation des actifs nets résultant d'opérations sur actions  | 178 601 042          | 465 064 836          |
| <b>(Diminution)/Augmentation totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                   | <b>(17 263 721)</b>  | <b>489 186 422</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>                       | <b>1 188 448 051</b> | <b>1 205 711 772</b> |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

| Notes  | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|--|----------------------|----------------------|
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(195 864 763)</b> | <b>24 121 586</b>    |
| <b>Ajustement pour :</b>   |                      |                      |
| Variation de la trésorerie détenue par/à payer au courtier   | (327 176)            | 304 789              |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat   | 15 136 400           | (485 546 965)        |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés  | 209 618              | (396 816)            |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>  | <b>(180 845 921)</b> | <b>(461 517 406)</b> |
| Variation des montants à recevoir  | (2 134 698)          | (2 021 798)          |
| Variation des montants à payer   | (18 809)             | 206 164              |
| <b>Sorties de trésorerie sur opérations</b>  | <b>(2 153 507)</b>   | <b>(1 815 634)</b>   |
| <b>Sorties de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>   | <b>(182 999 428)</b> | <b>(463 333 040)</b> |
| <b>Activités de financement</b>  |                      |                      |
| Produits des souscriptions   | 5 539 424 920        | 672 800 966          |
| Paiements sur rachats  | 5 (360 823 878)      | (204 310 740)        |
| <b>Trésorerie nette générée sur activités de financement</b>   | <b>178 601 042</b>   | <b>468 490 226</b>   |
| <b>(Diminution)/Augmentation nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>   | <b>(4 398 386)</b>   | <b>5 157 186</b>     |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier   | 8 361 391            | 3 204 205            |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>  | <b>3 963 005</b>     | <b>8 361 391</b>     |
| <b>Informations supplémentaires</b>  |                      |                      |
| Impôts payés   | (9 272 935)          | (5 569 928)          |
| Intérêts reçus   | 9 229                | 453                  |
| Intérêts payés   | -                    | (10 014)             |
| Dividendes reçus   | 68 674 925           | 40 423 752           |
| Distributions payées   | (54 995 675)         | (33 324 630)         |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                              | Juste valeur USD  | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,06 % (mars 2022 : 98,93 %)</b> |                   |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,06 % (mars 2022 : 98,93 %)</b>         |                   |                   |
| <b>Actions ordinaires – 88,31 % (mars 2022 : 89,31 %)</b> |                   |                   | <b>(suite)</b>  |                   |                   |
| <b>Dollar australien – 1,57 %</b>                         |                   |                   | <b>Actions ordinaires – 88,31 % (mars 2022 : 89,31 %) (suite)</b> |                   |                   |
| 654 597 JB Hi-Fi Ltd                                      | 18 619 937        | 1,57              | <b>Dollar de Hong Kong – 8,10 % (suite)</b>                       |                   |                   |
|   | <b>18 619 937</b> | <b>1,57</b>       | 311 500 Sun Hung Kai Properties Ltd                               | 4 365 075         | 0,37              |
| <b>Dollar canadien – 8,36 %</b>                           |                   |                   | 1 630 600 Swire Properties Ltd                                    | 4 196 482         | 0,35              |
| 18 117 Bank of Montreal                                   | 1 611 501         | 0,14              |   | <b>96 261 183</b> | <b>8,10</b>       |
| 46 067 Bank of Nova Scotia                                | 2 317 051         | 0,19              | <b>Yen japonais – 7,09 %</b>                                      |                   |                   |
| 166 553 BCE   | 7 450 508         | 0,63              | 3 960 100 ENEOS Holdings Inc                                      | 13 842 052        | 1,16              |
| 54 712 Canadian Imperial Bank of Commerce                 | 2 316 876         | 0,19              | 750 500 JAFCO Group Co Ltd  | 10 674 778        | 0,90              |
| 94 210 Canadian Natural Resources Ltd                     | 5 206 314         | 0,44              | 821 000 Lixil Corp  | 13 429 410        | 1,13              |
| 52 658 Canadian Tire Corp Ltd                             | 6 862 446         | 0,58              | 516 800 Mitsui Mining & Smelting Co Ltd                           | 12 484 207        | 1,05              |
| 214 824 Canadian Utilities Ltd                            | 5 977 960         | 0,50              | 301 600 MS&AD Insurance Group Holdings Inc                        | 9 304 753         | 0,78              |
| 101 372 Canadian Western Bank                             | 1 854 653         | 0,16              | 589 100 SBI Holdings Inc  | 11 614 726        | 0,98              |
| 186 381 Capital Power Corp                                | 5 734 622         | 0,48              | 396 200 Takeda Pharmaceutical Co Ltd                              | 12 949 658        | 1,09              |
| 165 438 Emera Inc   | 6 786 971         | 0,57              |   | <b>84 299 584</b> | <b>7,09</b>       |
| 93 642 Great-West Lifeco Inc                              | 2 478 493         | 0,21              | <b>Nouveau dollar de Taïwan – 1,49 %</b>                          |                   |                   |
| 74 124 IGM Financial Inc                                  | 2 212 191         | 0,19              | 5 569 000 Vanguard International Semiconductor Corp               | 17 724 717        | 1,49              |
| 349 882 Keyera Corp                                       | 7 649 912         | 0,64              |   | <b>17 724 717</b> | <b>1,49</b>       |
| 110 132 Manulife Financial Corp                           | 2 018 160         | 0,17              | <b>Livre sterling – 6,55 %</b>                                    |                   |                   |
| 236 099 Parkland Corp                                     | 5 652 350         | 0,48              | 499 474 British American Tobacco PLC                              | 17 542 208        | 1,48              |
| 197 528 Pembina Pipeline Corp                             | 6 389 907         | 0,54              | 229 647 DCC PLC   | 13 398 814        | 1,13              |
| 90 379 Power Corp of Canada                               | 2 306 643         | 0,19              | 1 183 249 IG Group Holdings PLC                                   | 10 221 093        | 0,86              |
| 295 748 Russel Metals Inc                                 | 7 502 189         | 0,63              | 4 840 795 Legal & General Group PLC                               | 14 299 124        | 1,20              |
| 35 920 Sun Life Financial                                 | 1 675 833         | 0,14              | 1 662 881 Schroders PLC   | 9 459 297         | 0,79              |
| 193 328 TC Energy Corp                                    | 7 509 700         | 0,63              | 990 603 United Utilities Group PLC                                | 12 983 440        | 1,09              |
| 283 554 TELUS Corp  | 5 621 424         | 0,47              |   | <b>77 903 976</b> | <b>6,55</b>       |
| 38 054 TELUS Corp (Non Canadian)                          | 752 053           | 0,06              | <b>Riyal saoudien – 1,11 %</b>                                    |                   |                   |
| 25 197 Toronto-Dominion Bank                              | 1 507 147         | 0,13              | 1 232 248 Saudi Telecom Co  | 13 147 437        | 1,11              |
|   | <b>99 394 904</b> | <b>8,36</b>       |   | <b>13 147 437</b> | <b>1,11</b>       |
| <b>Euro – 7,51 %</b>                                      |                   |                   | <b>Dollar de Singapour – 1,36 %</b>                               |                   |                   |
| 14 568 233 A2A SpA  | 23 267 493        | 1,96              | 5 872 400 Singapore Technologies Engineering Ltd                  | 16 165 608        | 1,36              |
| 45 831 Allianz SE   | 10 595 968        | 0,89              |   | <b>16 165 608</b> | <b>1,36</b>       |
| 374 770 BASF SE   | 19 690 685        | 1,66              | <b>Won sud-coréen – 1,08 %</b>                                    |                   |                   |
| 577 853 Bouygues SA                                       | 19 519 944        | 1,64              | 198 840 KT&G Corp   | 12 814 769        | 1,08              |
| 344 809 Deutsche Post AG                                  | 16 142 277        | 1,36              |   | <b>12 814 769</b> | <b>1,08</b>       |
|   | <b>89 216 367</b> | <b>7,51</b>       | <b>Franç suisse – 6,79 %</b>                                      |                   |                   |
| <b>Dollar de Hong Kong – 8,10 %</b>                       |                   |                   | 654 897 Adecco Group AG   | 23 764 336        | 2,00              |
| 9 112 200 China Gas Holdings Ltd                          | 12 839 580        | 1,08              | 61 369 Baloise Holding AG   | 9 565 967         | 0,80              |
| 1 047 000 CK Infrastructure Holdings Ltd                  | 5 695 183         | 0,48              | 83 362 Helvetia Holding AG  | 11 625 409        | 0,98              |
| 1 670 000 Henderson Land Development Co Ltd               | 5 776 063         | 0,48              | 235 502 Holcim AG   | 15 183 699        | 1,28              |
| 21 704 000 Lenovo Group Ltd                               | 23 502 326        | 1,98              | 18 265 Swiss Life Holding AG                                      | 11 260 301        | 0,95              |
| 6 723 500 Longfor Group Holdings Ltd                      | 18 972 485        | 1,60              | 19 346 Zurich Insurance Group AG                                  | 9 269 057         | 0,78              |
| 1 421 500 Ping An Insurance Group Co of China Ltd         | 9 253 390         | 0,78              |   | <b>80 668 769</b> | <b>6,79</b>       |
| 1 125 500 Power Assets Holdings Ltd                       | 6 036 159         | 0,51              | <b>Dollar américain – 37,30 %</b>                                 |                   |                   |
| 4 157 310 Sino Land Co Ltd                                | 5 624 440         | 0,47              | 149 393 3M Co   | 15 702 698        | 1,32              |
|   |                   |                   | 192 498 Best Buy Co Inc   | 15 066 822        | 1,27              |



## SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

|   | Juste valeur<br>USD  | % du<br>Comp. |
|---|----------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | 1 177 500 521        | 99,08         |
| <b>Disponibilités bancaires*</b><br>(mars 2022 : 0,69 %)                                | 3 963 005            | 0,33          |
| <b>Liquidités détenues auprès d'un<br/>courtier* (mars 2022 : 0,00 %)</b>               | 272 033              | 0,02          |
| <b>Montants à recevoir du courtier</b><br>(mars 2022 : (0,01 %))                        | -                    | -             |
| <b>Autres actifs nets</b><br>(mars 2022 : 0,36 %)                                       | 6 712 492            | 0,57          |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs<br/>d'actions de participation rachetables</b> | <b>1 188 448 051</b> | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company, à l'exception des liquidités détenues auprès d'un courtier, en l'occurrence Goldman Sachs.

Le courtier pour les contrats à terme standardisés ouverts est Goldman Sachs.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

|   | % du<br>total<br>des actifs |
|---|-----------------------------|
| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                        |                             |
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs | 96,07                       |
| Instruments financiers dérivés négociés en Bourse                       | 0,02                        |
| Autres actifs   | 3,91                        |
| <b>Total des actifs</b>   | <b>100,00</b>               |

## SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD        | 2022<br>USD        |             |
|--|-------|--------------------|--------------------|-------------|
| <b>Actifs circulants</b>   |       |                    |                    |             |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                         | 1(e)  |                    |                    |             |
| Valeurs mobilières   |       | 133 612 388        | 155 967 907        |             |
| Instruments financiers dérivés   |       | 26 673             | 41 357             |             |
|  |       | <b>133 639 061</b> | <b>156 009 264</b> |             |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie  | 1(f)  | 1 053 328          | 934 758            |             |
| Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties à des instruments financiers ouverts | 1(g)  | 75 747             | 41 105             |             |
| Créances :   |       |                    |                    |             |
| Dividendes à recevoir  |       | 570 515            | 704 390            |             |
| <b>Total des actifs circulants</b>   |       | <b>135 338 651</b> | <b>157 689 517</b> |             |
| <b>Passifs circulants</b>  |       |                    |                    |             |
| Liquidités dues aux courtiers et aux contreparties pour des instruments financiers ouverts       | 1(g)  | (20 205)           | (46 036)           |             |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :   |       |                    |                    |             |
| Charges à payer  |       | (62 358)           | (71 750)           |             |
| <b>Total des passifs circulants</b>  |       | <b>(82 563)</b>    | <b>(117 786)</b>   |             |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>              |       | <b>135 256 088</b> | <b>157 571 731</b> |             |
|  |       | <b>2023</b>        | <b>2022</b>        | <b>2021</b> |
| Valeur liquidative par action  | 5     | 40,25 USD          | 46,90 USD          | 50,92 USD   |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | Notes | 2023<br>USD         | 2022<br>USD         |
|---|-------|---------------------|---------------------|
| Produits de dividendes  |       | 5 790 671           | 7 590 483           |
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur  |       | 4 294               | 5                   |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 9     | (21 876 794)        | (15 889 810)        |
| <b>Total des charges d'investissement</b>   |       | <b>(16 081 829)</b> | <b>(8 299 322)</b>  |
| Charges opérationnelles   | 3     | (749 261)           | (1 068 539)         |
| <b>Perte nette pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(16 831 090)</b> | <b>(9 367 861)</b>  |
| <b>Charges financières</b>  |       |                     |                     |
| Charges d'intérêts  |       | (2 985)             | (2 932)             |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables   | 7     | (4 761 720)         | (5 814 600)         |
| <b>Perte pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(21 595 795)</b> | <b>(15 185 393)</b> |
| Impôt sur les plus-values de capital  | 2     | (3 006)             | (96 977)            |
| Retenue à la source sur produits d'investissement   | 2     | (372 468)           | (440 484)           |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(21 971 269)</b> | <b>(15 722 854)</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.



## SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|   | 2023<br>USD         | 2022<br>USD         |
|---|---------------------|---------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier               | 157 571 731         | 213 861 155         |
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(21 971 269)</b> | <b>(15 722 854)</b> |
| <b>Opérations sur actions</b>   |                     |                     |
| Produits sur actions de participation rachetables émises  | 11 443 030          | 23 056 629          |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables  | (11 787 404)        | (63 623 199)        |
| Diminution des actifs nets résultant d'opérations sur actions   | (344 374)           | (40 566 570)        |
| <b>Diminution totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                   | <b>(22 315 643)</b> | <b>(56 289 424)</b> |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>        | <b>135 256 088</b>  | <b>157 571 731</b>  |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

| Notes   | 2023<br>USD         | 2022<br>USD         |
|---|---------------------|---------------------|
| <b>Diminution des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(21 971 269)</b> | <b>(15 722 854)</b> |
| <b>Ajustement pour :</b>  |                     |                     |
| Variation de la trésorerie détenue par/à payer au courtier  | (60 473)            | 108 601             |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat  | 22 355 519          | 55 427 393          |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés   | 14 684              | (10 555)            |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>   | <b>338 461</b>      | <b>39 802 585</b>   |
| Variation des montants à recevoir   | 133 875             | 135 200             |
| Variation des montants à payer  | (9 392)             | (24 220)            |
| <b>Entrées de trésorerie sur opérations</b>   | <b>124 483</b>      | <b>110 980</b>      |
| <b>Entrées de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>  | <b>462 944</b>      | <b>39 913 565</b>   |
| <b>Activités de financement</b>   |                     |                     |
| Produits des souscriptions  | 5 11 443 030        | 23 056 629          |
| Paiements sur rachats   | 5 (11 787 404)      | (63 623 199)        |
| <b>Trésorerie nette utilisée sur activités de financement</b>   | <b>(344 374)</b>    | <b>(40 566 570)</b> |
| <b>Augmentation/(Diminution) nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>                                    | <b>118 570</b>      | <b>(653 005)</b>    |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier  | 934 758             | 1 587 763           |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>   | <b>1 053 328</b>    | <b>934 758</b>      |
| <b>Informations supplémentaires</b>   |                     |                     |
| Impôts payés  | (375 474)           | (537 461)           |
| Intérêts reçus  | 4 294               | 5                   |
| Intérêts payés  | (2 985)             | (2 932)             |
| Dividendes reçus  | 5 924 546           | 7 725 683           |
| Distributions payées  | (4 761 720)         | (5 814 600)         |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                              | Juste valeur USD  | % des actifs nets |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,78 % (mars 2022 : 98,98 %)</b> |                   |                   |
| <b>Actions ordinaires – 92,52 % (mars 2022 : 90,01 %)</b> |                   |                   |
| <b>Dollar australien – 13,26 %</b>                        |                   |                   |
| 33 136 Altium Ltd   | 845 103           | 0,62              |
| 439 149 APA Group CVS NPV                                 | 2 976 496         | 2,20              |
| 107 665 Brickworks Ltd                                    | 1 633 261         | 1,21              |
| 98 532 carsales.com Ltd                                   | 1 460 399         | 1,08              |
| 78 691 Computershare Ltd                                  | 1 137 864         | 0,84              |
| 144 274 JB Hi-Fi Ltd                                      | 4 103 772         | 3,03              |
| 145 593 Northern Star Resources Ltd                       | 1 200 360         | 0,89              |
| 98 370 Sonic Healthcare Ltd                               | 2 295 375         | 1,70              |
| 398 784 Steadfast Group Ltd                               | 1 562 451         | 1,16              |
| 73 857 Technology One Ltd                                 | 719 232           | 0,53              |
|   | <b>17 934 313</b> | <b>13,26</b>      |
| <b>Dollar de Hong Kong – 34,36 %</b>                      |                   |                   |
| 98 400 AIA Group Ltd                                      | 1 036 027         | 0,77              |
| 5 506 000 Bosideng International Holdings Ltd             | 3 072 157         | 2,27              |
| 2 006 400 China Gas Holdings Ltd                          | 2 826 870         | 2,09              |
| 1 805 000 China Medical System Holdings Ltd               | 2 851 228         | 2,11              |
| 646 900 China Resources Gas Group Ltd                     | 2 385 716         | 1,76              |
| 594 000 China Resources Land Ltd                          | 2 708 960         | 2,00              |
| 700 000 CK Infrastructure Holdings Ltd                    | 3 807 668         | 2,82              |
| 1 316 000 CSPC Pharmaceutical Group                       | 1 294 215         | 0,96              |
| 4 291 000 Guangdong Investment Ltd                        | 4 389 420         | 3,25              |
| 3 096 238 Hong Kong & China Gas Co Ltd                    | 2 725 496         | 2,01              |
| 1 482 000 Longfor Group Holdings Ltd                      | 4 181 721         | 3,09              |
| 2 002 200 New China Life Insurance Co Ltd                 | 4 759 400         | 3,52              |
| 450 000 Ping An Insurance Group Co of China Ltd           | 2 929 318         | 2,17              |
| 1 136 400 Sinopharm Group Co Ltd                          | 3 438 175         | 2,54              |
| 1 088 400 Swire Properties Ltd                            | 2 800 741         | 2,07              |
| 117 000 Techtronic Industries Co Ltd                      | 1 264 651         | 0,93              |
|   | <b>46 471 763</b> | <b>34,36</b>      |
| <b>Roupie indienne – 0,93 %</b>                           |                   |                   |
| 72 724 Infosys Ltd  | 1 263 605         | 0,93              |
|   | <b>1 263 605</b>  | <b>0,93</b>       |
| <b>Roupie indonésienne – 0,92 %</b>                       |                   |                   |
| 2 121 600 Bank Central Asia Tbk PT                        | 1 238 054         | 0,92              |
|   | <b>1 238 054</b>  | <b>0,92</b>       |
| <b>Yen japonais – 28,57 %</b>                             |                   |                   |
| 53 600 Aeon Mall Co Ltd                                   | 699 551           | 0,52              |
| 68 200 Alfresa Holdings Corp                              | 869 090           | 0,64              |
| 21 300 Asahi Group Holdings Ltd                           | 788 047           | 0,58              |
| 50 300 Astellas Pharma                                    | 711 661           | 0,53              |
| 18 300 Azbil  | 496 378           | 0,37              |
| 30 700 Benefit One Inc                                    | 432 739           | 0,32              |
| 92 300 Chiba Bank Ltd                                     | 592 956           | 0,44              |
| 58 900 COMSYS Holdings Corp                               | 1 081 168         | 0,80              |

| Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,78 % (mars 2022 : 98,98 %)</b>         |                  |                   |
| <b>(suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 92,52 % (mars 2022 : 90,01 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Yen japonais – 28,57 % (suite)</b>                             |                  |                   |
| 65 800 EXEO Group Inc   | 1 185 082        | 0,88              |
| 9 900 Fujitsu General Ltd   | 277 831          | 0,21              |
| 58 300 Hakuholdo DY Holdings Inc                                  | 654 884          | 0,48              |
| 5 200 Hikari Tsushin Inc  | 725 554          | 0,54              |
| 122 300 Hulic Co Ltd  | 998 874          | 0,74              |
| 28 500 Itochu Techno-Solutions                                    | 697 028          | 0,52              |
| 17 800 Kao Corp   | 691 056          | 0,51              |
| 28 000 KDDI Corp  | 861 102          | 0,64              |
| 7 900 Kurita Water Industries                                     | 358 524          | 0,26              |
| 39 000 Lion Corp  | 419 333          | 0,31              |
| 29 000 Mani Inc   | 393 523          | 0,29              |
| 51 000 Medipal Holdings Corp                                      | 691 292          | 0,51              |
| 19 600 Morinaga & Co Ltd/Japan                                    | 552 994          | 0,41              |
| 10 300 Murata Manufacturing Co Ltd                                | 622 226          | 0,46              |
| 53 700 NEC Networks & System Integration Corp                     | 651 631          | 0,48              |
| 51 400 Nippon Gas Co Ltd  | 743 058          | 0,55              |
| 30 600 Nippon Sanso Holdings Corp                                 | 547 669          | 0,40              |
| 27 600 Nippon Telegraph & Telephone Corp                          | 821 634          | 0,61              |
| 16 000 Nissan Chemical Corp                                       | 720 114          | 0,53              |
| 13 100 Nitto Denko Corp   | 841 573          | 0,62              |
| 45 800 Nomura Real Estate Holdings Inc                            | 1 008 295        | 0,75              |
| 14 700 Nomura Research Institute Ltd                              | 338 534          | 0,25              |
| 18 500 NTT Data Corp  | 240 754          | 0,18              |
| 21 700 Open House Group Co Ltd                                    | 807 085          | 0,60              |
| 7 200 Oracle Corp Japan   | 515 561          | 0,38              |
| 23 800 Otsuka Corp  | 837 802          | 0,62              |
| 15 300 Rinnai Corp  | 371 895          | 0,27              |
| 109 200 Sanwa Holdings Corp                                       | 1 161 824        | 0,86              |
| 72 400 SBI Holdings Inc   | 1 427 437        | 1,06              |
| 42 100 SCSK Corp  | 612 093          | 0,45              |
| 56 100 Sekisui Chemical   | 790 770          | 0,58              |
| 60 200 Sekisui House Ltd  | 1 220 374        | 0,90              |
| 27 200 Seria Co Ltd   | 535 866          | 0,40              |
| 10 100 Seven & i Holdings Co Ltd                                  | 453 434          | 0,33              |
| 27 000 Shin-Etsu Chemical Co Ltd                                  | 867 270          | 0,64              |
| 9 800 Shionogi & Co Ltd   | 440 113          | 0,33              |
| 20 400 Ship Healthcare Holdings Inc                               | 373 543          | 0,28              |
| 13 300 SHO-BOND Holdings Co Ltd                                   | 547 629          | 0,40              |
| 23 500 Sundrug Co Ltd   | 641 840          | 0,47              |
| 104 200 Takara Holdings Inc                                       | 800 153          | 0,59              |
| 8 900 Terumo  | 239 001          | 0,18              |
| 12 400 TIS Inc  | 325 163          | 0,24              |
| 42 700 Tokio Marine Holdings Inc                                  | 817 168          | 0,60              |

## SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation Investissement   | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|--|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,78 % (mars 2022 : 98,98 %) (suite)</b>                  |                    |                   |
| <b>Actions ordinaires – 92,52 % (mars 2022 : 90,01 %) (suite)</b>                  |                    |                   |
| <b>Yen japonais – 28,57 % (suite)</b>  |                    |                   |
| 23 800 Tokyo Century Corp  | 787 730            | 0,58              |
| 81 200 Tokyo Tatemono Co Ltd   | 985 333            | 0,73              |
| 87 900 TS Tech Co Ltd  | 1 108 905          | 0,82              |
| 12 000 Welcia Holdings Co Ltd  | 255 526            | 0,19              |
| 3 800 Yakult Honsha Co Ltd   | 274 957            | 0,20              |
| 19 500 Zenkoku Hoshu Co Ltd  | 731 854            | 0,54              |
|  | <b>38 644 481</b>  | <b>28,57</b>      |
| <b>Nouveau dollar de Taïwan – 9,99 %</b>   |                    |                   |
| 138 000 Advantech Co Ltd   | 1 681 517          | 1,24              |
| 19 000 ASPEED Technology Inc   | 1 644 306          | 1,22              |
| 221 337 Chailease Holding Co Ltd   | 1 624 725          | 1,20              |
| 174 000 Sinbon Electronics Co Ltd  | 1 954 446          | 1,44              |
| 4 809 000 Wistron Corp   | 6 609 957          | 4,89              |
|  | <b>13 514 951</b>  | <b>9,99</b>       |
| <b>Dollar néo-zélandais – 2,16 %</b>   |                    |                   |
| 51 410 EBOS Group Ltd  | 1 495 657          | 1,10              |
| 85 844 Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd   | 1 431 326          | 1,06              |
|  | <b>2 926 983</b>   | <b>2,16</b>       |
| <b>Peso philippin – 1,55 %</b>   |                    |                   |
| 534 470 International Container Terminal Services Inc                              | 2 097 965          | 1,55              |
|  | <b>2 097 965</b>   | <b>1,55</b>       |
| <b>Won sud-coréen – 0,78 %</b>   |                    |                   |
| 9 521 LEENO Industrial Inc   | 1 048 016          | 0,78              |
|  | <b>1 048 016</b>   | <b>0,78</b>       |
| <b>Total des actions ordinaires</b>  | <b>125 140 131</b> | <b>92,52</b>      |
| <b>Certificats représentatifs de titres – 0,73 % (mars 2022 : 0,69 %)</b>          |                    |                   |
| <b>Baht thaïlandais – 0,73 %</b>   |                    |                   |
| 626 129 Krungthai Card PCL   | 993 347            | 0,73              |
| <b>Total des certificats représentatifs de titres</b>                              | <b>993 347</b>     | <b>0,73</b>       |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 5,53 % (mars 2022 : 8,28 %)</b> |                    |                   |
| <b>Dollar australien – 1,32 %</b>  |                    |                   |
| 242 948 Charter Hall Group   | 1 789 859          | 1,32              |
|  | <b>1 789 859</b>   | <b>1,32</b>       |
| <b>Dollar de Hong Kong – 2,04 %</b>  |                    |                   |
| 429 000 Link REIT  | 2 759 826          | 2,04              |
|  | <b>2 759 826</b>   | <b>2,04</b>       |
| <b>Yen japonais – 2,17 %</b>   |                    |                   |
| 1 415 Japan Metropolitan Fund Invest   | 1 028 105          | 0,76              |
| 236 Japan Real Estate Investment Corp  | 936 269            | 0,69              |

| Participation Investissement   | Juste valeur USD   | % des actifs nets |
|--|--------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 98,78 % (mars 2022 : 98,98 %) (suite)</b>                          |                    |                   |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 5,53 % (mars 2022 : 8,28 %) (suite)</b> |                    |                   |
| <b>Yen japonais – 2,17 % (suite)</b>   |                    |                   |
| 870 Mori Hills REIT Investment Corp  | 964 851            | 0,72              |
|  | <b>2 929 225</b>   | <b>2,17</b>       |
| <b>Total des fiducies de placement immobilier de type REIT</b>                             | <b>7 478 910</b>   | <b>5,53</b>       |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>  | <b>133 612 388</b> | <b>98,78</b>      |

**Instruments financiers dérivés – 0,02 % (mars 2022 : 0,03 %)**

**Contrats à terme standardisés – 0,02 % (mars 2022 : 0,03 %)**

| Montant notionnel | Prix du coût moyen   | Plus-values latentes USD | % des actifs nets |
|-------------------|--|--------------------------|-------------------|
| 504 799           | 2 524 4 of Hang Seng Index Futures Contracts Expiring 27 April 2023      | 17 013                   | 0,01              |
| 237 912           | 4 758 2 of SPI 200 Futures Long Futures Contracts Expiring 15 June 2023  | 2 897                    | 0,00              |
| 745 923           | 15 5 of Topix Index Futures Long Futures Contracts Expiring 08 June 2023 | 6 763                    | 0,01              |
|                   | <b>Plus-values latentes nettes sur contrats à terme standardisés</b>     | <b>26 673</b>            | <b>0,02</b>       |
|                   | <b>Total des instruments financiers dérivés</b>                          | <b>26 673</b>            | <b>0,02</b>       |

|   | Juste valeur USD   | % du Comp.    |
|---|--------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | <b>133 639 061</b> | <b>98,80</b>  |
| <b>Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,59 %)</b>                               | <b>1 053 328</b>   | <b>0,78</b>   |
| <b>Liquidités détenues auprès d'un courtier* (mars 2022 : 0,03 %)</b>               | <b>75 747</b>      | <b>0,06</b>   |
| <b>Montants à recevoir du courtier* (mars 2022 : (0,03 %))</b>                      | <b>(20 205)</b>    | <b>(0,01)</b> |
| <b>Autres actifs nets (mars 2022 : 0,40 %)</b>                                      | <b>508 157</b>     | <b>0,37</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>135 256 088</b> | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company, à l'exception des liquidités détenues auprès d'un courtier et des liquidités dues au courtier, en l'occurrence Goldman Sachs.

Le courtier pour les contrats à terme standardisés ouverts est Goldman Sachs.

## SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                        | <b>% du total des actifs</b> |
|---|------------------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs | 98,72                        |
| Instruments financiers dérivés négociés en Bourse                       | 0,02                         |
| Autres actifs   | 1,26                         |
| <b>Total des actifs</b>   | <b>100,00</b>                |

## SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>GBP        | 2022<br>GBP        |
|--|-------|--------------------|--------------------|
| <b>Actifs circulants</b>   |       |                    |                    |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                         |       |                    |                    |
|  | 1(e)  |                    |                    |
| Valeurs mobilières   |       | 123 860 115        | 122 789 687        |
| Instruments financiers dérivés   |       | 7 015              | 52 816             |
|  |       | <b>123 867 130</b> | <b>122 842 503</b> |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie  | 1(f)  | 97 654             | 488 696            |
| Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties à des instruments financiers ouverts | 1(g)  | 34 224             | 28 662             |
| Créances :   |       |                    |                    |
| Dividendes à recevoir  |       | 735 757            | 1 301 762          |
| <b>Total des actifs circulants</b>   |       | <b>124 734 765</b> | <b>124 661 623</b> |
| <b>Passifs circulants</b>  |       |                    |                    |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :   |       |                    |                    |
| Charges à payer  |       | (31 714)           | (31 504)           |
| <b>Total des passifs circulants</b>  |       | <b>(31 714)</b>    | <b>(31 504)</b>    |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>              |       |                    |                    |
|  |       | <b>124 703 051</b> | <b>124 630 119</b> |
|  |       | <b>2023</b>        | <b>2022</b>        |
|  |       | <b>2021</b>        |                    |
| Valeur liquidative par action  | 5     | 9,82 GBP           | 10,93 GBP          |
|  |       |                    | 10,38 GBP          |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>GBP         | 2022<br>GBP       |
|--|-------|---------------------|-------------------|
| Produits de dividendes   |       | 5 591 458           | 6 252 478         |
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur   |       | 70                  | -                 |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat                 | 9     | (15 770 328)        | 4 679 060         |
| Produits divers  |       | 670                 | 24 803            |
| <b>Total des (charges)/revenus d'investissement</b>  |       | <b>(10 178 130)</b> | <b>10 956 341</b> |
| Charges opérationnelles  | 3     | (425 633)           | (383 166)         |
| <b>(Perte)/Bénéfice net(te) pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(10 603 763)</b> | <b>10 573 175</b> |
| <b>Charges financières</b>   |       |                     |                   |
| Charges d'intérêts   |       | -                   | (705)             |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables  | 7     | (6 326 280)         | (5 073 220)       |
| <b>(Perte)/Bénéfice pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(16 930 043)</b> | <b>5 499 250</b>  |
| Retenue à la source sur produits d'investissement  | 2     | (119 068)           | (34 687)          |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(17 049 111)</b> | <b>5 464 563</b>  |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | 2023<br>GBP         | 2022<br>GBP        |
|--|---------------------|--------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier                              | 124 630 119         | 109 013 832        |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(17 049 111)</b> | <b>5 464 563</b>   |
| <b>Opérations sur actions</b>  |                     |                    |
| Produits sur actions de participation rachetables émises   | 50 844 436          | 18 783 412         |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables   | (33 722 393)        | (8 631 688)        |
| Augmentation des actifs nets résultant d'opérations sur actions  | 17 122 043          | 10 151 724         |
| <b>Augmentation totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                                | <b>72 932</b>       | <b>15 616 287</b>  |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>                       | <b>124 703 051</b>  | <b>124 630 119</b> |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.



## SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

| Notes  | 2023<br>GBP         | 2022<br>GBP        |
|--|---------------------|--------------------|
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(17 049 111)</b> | <b>5 464 563</b>   |
| <b>Ajustement pour :</b>   |                     |                    |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat   | (5 562)             | 28 530             |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat   | (1 070 428)         | (14 299 556)       |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés  | 45 801              | (51 624)           |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>  | <b>(18 079 300)</b> | <b>(8 858 087)</b> |
| Variation des montants à recevoir  | 566 005             | (922 652)          |
| Variation des montants à payer   | 210                 | 5 354              |
| <b>Sorties de trésorerie sur opérations</b>  | <b>566 215</b>      | <b>(917 298)</b>   |
| <b>Entrées/(Sorties) de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>   | <b>(17 513 085)</b> | <b>(9 775 385)</b> |
| <b>Activités de financement</b>  |                     |                    |
| Produits des souscriptions   | 5 50 844 436        | 18 783 412         |
| Paiements sur rachats  | 5 (33 722 393)      | (8 631 688)        |
| <b>Trésorerie nette générée sur activités de financement</b>   | <b>17 122 043</b>   | <b>10 151 724</b>  |
| <b>(Diminution)/Augmentation nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>   | <b>(391 042)</b>    | <b>376 339</b>     |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier   | 488 696             | 112 357            |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>  | <b>97 654</b>       | <b>488 696</b>     |
| <b>Informations supplémentaires</b>  |                     |                    |
| Impôts payés   | (119 068)           | (34 687)           |
| Intérêts reçus   | 70                  | -                  |
| Intérêts payés   | -                   | (705)              |
| Dividendes reçus   | 6 157 463           | 5 329 826          |
| Distributions payées   | (6 326 280)         | (5 073 220)        |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>GBP | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,32 % (mars 2022 : 98,53 %)</b>                           |                     |                         |
| <b>Actions ordinaires – 78,60 % (mars 2022 : 91,12 %)</b>                           |                     |                         |
| <b>Livre sterling – 78,60 %</b>   |                     |                         |
| 30 078 Ashtead Group  | 1 491 267           | 1,20                    |
| 467 517 BAE Systems PLC   | 4 593 822           | 3,68                    |
| 187 880 British American Tobacco PLC  | 5 336 732           | 4,28                    |
| 91 828 Bunzl PLC  | 2 807 182           | 2,25                    |
| 99 984 Cranswick PLC  | 3 003 519           | 2,41                    |
| 26 939 Croda International PLC  | 1 750 496           | 1,40                    |
| 44 134 Dechra Pharmaceuticals PLC   | 1 169 551           | 0,94                    |
| 65 893 Diageo PLC   | 2 381 373           | 1,91                    |
| 80 750 Diploma PLC  | 2 269 075           | 1,82                    |
| 412 118 Drax Group PLC  | 2 503 617           | 2,01                    |
| 71 405 Experian PLC   | 1 899 373           | 1,52                    |
| 46 473 Halma PLC  | 1 035 883           | 0,83                    |
| 632 344 Hargreaves Lansdown PLC   | 5 054 958           | 4,05                    |
| 182 779 Hikma Pharmaceuticals PLC   | 3 061 548           | 2,46                    |
| 764 856 IG Group Holdings PLC   | 5 342 519           | 4,28                    |
| 432 558 Intermediate Capital Group PLC  | 5 264 231           | 4,22                    |
| 58 811 Intertek Group PLC   | 2 383 610           | 1,91                    |
| 2 386 392 Legal & General Group PLC   | 5 701 091           | 4,57                    |
| 24 025 London Stock Exchange Group PLC  | 1 890 287           | 1,52                    |
| 477 247 National Grid PLC   | 5 233 013           | 4,20                    |
| 467 760 Pearson PLC   | 3 949 766           | 3,17                    |
| 1 037 118 Pets at Home Group PLC  | 3 826 966           | 3,07                    |
| 112 300 RELX PLC  | 2 940 014           | 2,36                    |
| 244 780 RS GROUP PLC  | 2 237 289           | 1,79                    |
| 480 363 Sage Group PLC  | 3 722 813           | 2,99                    |
| 1 062 329 Schroders PLC   | 4 886 713           | 3,92                    |
| 187 245 Smith & Nephew PLC  | 2 100 889           | 1,68                    |
| 87 406 Spectris PLC   | 3 198 186           | 2,56                    |
| 15 675 Spirax-Sarco Engineering PLC   | 1 858 271           | 1,49                    |
| 122 300 Unilever PLC  | 5 124 370           | 4,11                    |
| <b>Total des actions ordinaires</b>   | <b>98 018 424</b>   | <b>78,60</b>            |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 20,72 % (mars 2022 : 7,41 %)</b> |                     |                         |
| <b>Livre sterling – 20,72 %</b>   |                     |                         |
| 7 868 500 Assura PLC  | 3 844 549           | 3,08                    |
| 305 051 Big Yellow Group PLC  | 3 566 046           | 2,86                    |
| 112 795 Derwent London PLC  | 2 659 706           | 2,13                    |
| 1 958 159 LondonMetric Property PLC   | 3 438 527           | 2,76                    |
| 3 866 127 Primary Health Properties PLC   | 3 912 521           | 3,14                    |
| 276 297 Safestore Holdings PLC  | 2 624 821           | 2,10                    |
| 265 026 Segro PLC   | 2 034 340           | 1,63                    |

| Participation Investissement  | Juste valeur<br>GBP | % des<br>actifs<br>nets |
|---|---------------------|-------------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,32 % (mars 2022 : 98,53 %)</b>                           |                     |                         |
| <b>(suite)</b>  |                     |                         |
| <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 20,72 % (mars 2022 : 7,41 %)</b> |                     |                         |
| <b>(suite)</b>  |                     |                         |
| <b>Livre sterling – 20,72 % (suite)</b>   |                     |                         |
| 4 343 165 Supermarket Income Reit PLC   | 3 761 181           | 3,02                    |
| <b>Total des fiducies de placement immobilier de type REIT</b>                      | <b>25 841 691</b>   | <b>20,72</b>            |
| <b>Total des valeurs mobilières</b>   | <b>123 860 115</b>  | <b>99,32</b>            |

**Instruments financiers dérivés – 0,01 % (mars 2022 : 0,04 %)**

**Contrats à terme standardisés – 0,01 % (mars 2022 : 0,04 %)**

| Montant<br>notionnel | Prix<br>du coût<br>moyen | Plus-<br>values<br>latentes<br>GBP  | % des<br>actifs<br>nets |
|----------------------|--------------------------|---|-------------------------|
| 680 495              | 7 561                    | 9 of FTSE 100 Index<br>Futures Long Futures<br>Contracts Expiring<br>16 June 2023 | 7 015                   |
|                      |                          |   | 0,01                    |
|                      |                          | <b>Plus-values latentes nettes sur<br/>contrats à terme standardisés</b>          | <b>7 015</b>            |
|                      |                          |   | <b>0,01</b>             |
|                      |                          | <b>Total des instruments financiers<br/>dérivés</b>                               | <b>7 015</b>            |
|                      |                          |   | <b>0,01</b>             |

|   | Juste valeur<br>GBP | % du<br>Comp. |
|---|---------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | <b>123 867 130</b>  | <b>99,33</b>  |
| <b>Disponibilités bancaires*</b><br>(mars 2022 : 0,39 %)                                | 97 654              | 0,08          |
| <b>Liquidités détenues auprès d'un<br/>courtier*</b> (mars 2022 : 0,02 %)               | 34 224              | 0,03          |
| <b>Autres actifs nets</b><br>(mars 2022 : 1,02 %)                                       | 704 043             | 0,56          |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs<br/>d'actions de participation rachetables</b> | <b>124 703 051</b>  | <b>100,00</b> |

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company, à l'exception des liquidités détenues auprès d'un courtier, en l'occurrence Goldman Sachs.

Le courtier pour les contrats à terme standardisés ouverts est Goldman Sachs.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

## SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| <b>Analyse du total des actifs (non auditée)</b>                        | <b>% du total des actifs</b> |
|---|------------------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs | 99,30                        |
| Instruments financiers dérivés négociés en Bourse                       | 0,00                         |
| Autres actifs   | 0,70                         |
| <b>Total des actifs</b>   | <b>100,00</b>                |

## SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État de la situation financière au 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |           |
|--|-------|----------------------|----------------------|-----------|
| <b>Actifs circulants</b>   |       |                      |                      |           |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                         | 1(e)  |                      |                      |           |
| Valeurs mobilières   |       | 4 893 884 309        | 3 918 482 532        |           |
| Instruments financiers dérivés   |       | 5 981 784            | 965 112              |           |
|  |       | <b>4 899 866 093</b> | <b>3 919 447 644</b> |           |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie  | 1(f)  | 2 721 462            | 3 779 198            |           |
| Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties à des instruments financiers ouverts | 1(g)  | 231 000              | -                    |           |
| Créances :   |       |                      |                      |           |
| Dividendes à recevoir  |       | 9 525 457            | 6 948 830            |           |
| Produits divers à recevoir   |       | 111                  | 100                  |           |
| À recevoir sur cessions d'investissements  |       | 4 716 124            | -                    |           |
| À recevoir sur cessions d'actions de fonds   |       | -                    | 24 849 782           |           |
| <b>Total des actifs circulants</b>   |       | <b>4 917 060 247</b> | <b>3 955 025 554</b> |           |
| <b>Passifs circulants</b>  |       |                      |                      |           |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :                        | 1(e)  |                      |                      |           |
| Instruments financiers dérivés   |       | (966 905)            | (1 046 036)          |           |
| Liquidités dues aux courtiers et aux contreparties pour des instruments financiers ouverts       | 1(g)  | -                    | (245 363)            |           |
| Dettes – Échéances inférieures à un an :   |       |                      |                      |           |
| Charges à payer  |       | (1 478 618)          | (1 113 673)          |           |
| À payer sur achats d'investissements   |       | -                    | (24 842 949)         |           |
| À payer sur rachats d'actions de fonds   |       | (4 717 443)          | -                    |           |
| <b>Total des passifs circulants</b>  |       | <b>(7 162 966)</b>   | <b>(27 248 021)</b>  |           |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>              |       | <b>4 909 897 281</b> | <b>3 927 777 533</b> |           |
|  |       | <b>2023</b>          | <b>2022</b>          |           |
| Valeur liquidative par action  |       |                      | <b>2021</b>          |           |
| Catégorie couverte en EUR  | 5     | 7,95 EUR             | 8,54 EUR             | 7,96 EUR  |
| Catégorie non couverte en USD  | 5     | 68,33 USD            | 70,83 USD            | 65,20 USD |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État du résultat global pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD          | 2022<br>USD        |
|--|-------|----------------------|--------------------|
| Produits de dividendes   |       | 139 075 867          | 102 498 697        |
| Produits sur actifs financiers à la juste valeur   |       | 574                  | -                  |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat                 | 9     | (171 720 441)        | 265 977 639        |
| Produits divers  |       | 157 504              | 82                 |
| <b>Total des (charges)/revenus d'investissement</b>  |       | <b>(32 486 496)</b>  | <b>368 476 418</b> |
| Charges opérationnelles  | 3     | (16 259 434)         | (11 780 569)       |
| <b>(Perte)/Bénéfice net(te) pour l'exercice financier avant charges financières et impôts</b>  |       | <b>(48 745 930)</b>  | <b>356 695 849</b> |
| <b>Charges financières</b>   |       |                      |                    |
| Charges d'intérêts   |       | -                    | (3 550)            |
| Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables  | 7     | (104 751 047)        | (75 640 937)       |
| <b>(Perte)/Bénéfice pour l'exercice financier avant impôt</b>  |       | <b>(153 496 977)</b> | <b>281 051 362</b> |
| Retenue à la source sur produits d'investissement  | 2     | (21 844 585)         | (15 543 886)       |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(175 341 562)</b> | <b>265 507 476</b> |

Les plus-values et moins-values résultent uniquement des activités poursuivies. Il n'y a pas eu de plus-values ou moins-values autres que celles constatées dans l'État du résultat global.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | 2023<br>USD          | 2022<br>USD          |
|--|----------------------|----------------------|
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables au début de l'exercice financier                              | 3 927 777 533        | 2 959 196 052        |
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> | <b>(175 341 562)</b> | <b>265 507 476</b>   |
| <b>Opérations sur actions</b>  |                      |                      |
| Produits sur actions de participation rachetables émises   | 1 876 032 489        | 1 396 170 539        |
| Coûts de rachat des actions de participation rachetables   | (718 571 179)        | (693 096 534)        |
| Augmentation des actifs nets résultant d'opérations sur actions  | 1 157 461 310        | 703 074 005          |
| <b>Augmentation totale des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b>                                | <b>982 119 748</b>   | <b>968 581 481</b>   |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables à la fin de l'exercice financier</b>                       | <b>4 909 897 281</b> | <b>3 927 777 533</b> |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF

### État des flux de trésorerie pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

|  | Notes | 2023<br>USD            | 2022<br>USD          |
|--|-------|------------------------|----------------------|
| <b>(Diminution)/Augmentation des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables résultant des opérations</b> |       | <b>(175 341 562)</b>   | <b>265 507 476</b>   |
| <b>Ajustement pour :</b>   |       |                        |                      |
| Variation de la trésorerie détenue par/à payer au courtier   |       | (476 363)              | 572 383              |
| Variation des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat   |       | (1 004 960 850)        | (934 617 515)        |
| Variation latente sur actifs et passifs dérivés  |       | (5 095 803)            | (840 901)            |
| <b>Flux de trésorerie d'exploitation avant variations du fonds de roulement</b>  |       | <b>(1 185 874 578)</b> | <b>(669 378 557)</b> |
| Variation des montants à recevoir  |       | (2 576 638)            | (1 503 872)          |
| Variation des montants à payer   |       | 364 945                | 253 693              |
| <b>Sorties de trésorerie sur opérations</b>  |       | <b>(2 211 693)</b>     | <b>(1 250 179)</b>   |
| <b>Sorties de trésorerie nettes sur activités d'exploitation</b>   |       | <b>(1 188 086 271)</b> | <b>(670 628 736)</b> |
| <b>Activités de financement</b>  |       |                        |                      |
| Produits des souscriptions   | 5     | 1 900 882 271          | 1 371 320 757        |
| Paiements sur rachats  | 5     | (713 853 736)          | (702 289 121)        |
| <b>Trésorerie nette générée sur activités de financement</b>   |       | <b>1 187 028 535</b>   | <b>669 031 636</b>   |
| <b>Diminution nette de la trésorerie et des équivalents de trésorerie</b>  |       | <b>(1 057 736)</b>     | <b>(1 597 100)</b>   |
| Trésorerie et équivalents de trésorerie au début de l'exercice financier   |       | 3 779 198              | 5 376 298            |
| <b>Trésorerie et équivalents de trésorerie à la fin de l'exercice financier</b>  |       | <b>2 721 462</b>       | <b>3 779 198</b>     |
| <b>Informations supplémentaires</b>  |       |                        |                      |
| Impôts payés   |       | (21 844 585)           | (15 543 886)         |
| Intérêts reçus   |       | 574                    | -                    |
| Intérêts payés   |       | -                      | (3 550)              |
| Dividendes reçus   |       | 136 499 240            | 100 994 694          |
| Distributions payées   |       | (104 751 047)          | (75 640 937)         |

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

## SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023

| Participation Investissement                              | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation Investissement                                      | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,68 % (mars 2022 : 99,76 %)</b> |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,68 % (mars 2022 : 99,76 %)</b>         |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 93,60 % (mars 2022 : 94,00 %)</b> |                  |                   | <b>(suite)</b>  |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 93,60 %</b>                         |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 93,60 % (mars 2022 : 94,00 %) (suite)</b> |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 93,60 %</b>                         |                  |                   | <b>Dollar américain – 93,60 % (suite)</b>                         |                  |                   |
| 770 676 3M Co   | 81 005 754       | 1,65              | 915 191 Essential Utilities Inc                                   | 39 948 087       | 0,81              |
| 616 131 A O Smith Corp                                    | 42 605 459       | 0,87              | 675 826 Eversource Energy   | 52 890 143       | 1,08              |
| 294 824 Abbott Laboratories                               | 29 853 878       | 0,61              | 212 165 Expeditors International of Washington                    | 23 363 610       | 0,48              |
| 442 295 AbbVie Inc  | 70 488 554       | 1,44              | 517 054 Exxon Mobil Corp  | 56 700 142       | 1,15              |
| 781 638 ABM Industries Inc                                | 35 126 812       | 0,72              | 37 798 FactSet Research Systems Inc                               | 15 689 572       | 0,32              |
| 571 946 Aflac Inc   | 36 901 956       | 0,75              | 942 437 Fastenal Co   | 50 835 052       | 1,04              |
| 119 612 Air Products and Chemicals Inc                    | 34 353 763       | 0,70              | 2 054 923 Flowers Foods Inc                                       | 56 325 439       | 1,15              |
| 49 275 Albemarle  | 10 891 746       | 0,22              | 200 694 Franklin Electric Co Inc                                  | 18 885 305       | 0,38              |
| 6 249 164 Amcor PLC                                       | 71 115 486       | 1,45              | 2 710 250 Franklin Resources Inc                                  | 73 014 135       | 1,49              |
| 318 771 American States Water Co                          | 28 335 554       | 0,58              | 153 833 General Dynamics Corp                                     | 35 106 229       | 0,72              |
| 218 690 AptarGroup Inc                                    | 25 846 971       | 0,53              | 222 373 Genuine Parts Co  | 37 205 227       | 0,76              |
| 358 729 Archer-Daniels-Midland Co                         | 28 576 352       | 0,58              | 371 274 Graco Inc   | 27 106 715       | 0,55              |
| 410 057 Atmos Energy Corp                                 | 46 074 005       | 0,94              | 277 478 HB Fuller Co  | 18 993 369       | 0,39              |
| 156 058 Automatic Data Processing                         | 34 743 193       | 0,71              | 965 447 Hormel Foods Corp   | 38 502 026       | 0,78              |
| 1 575 339 Avista Corp                                     | 66 873 141       | 1,36              | 184 916 Illinois Tool Works Inc                                   | 45 017 800       | 0,92              |
| 128 898 Badger Meter Inc                                  | 15 702 354       | 0,32              | 590 400 International Business Machines Corp                      | 77 395 536       | 1,58              |
| 1 335 642 Bank OZK  | 45 678 956       | 0,93              | 497 147 International Flavors & Fragrances Inc                    | 45 717 638       | 0,93              |
| 103 848 Becton Dickinson and Co                           | 25 706 534       | 0,52              | 306 891 J M Smucker Co  | 48 295 437       | 0,98              |
| 897 949 Black Hills Corp                                  | 56 660 582       | 1,15              | 610 495 John Wiley & Sons Inc                                     | 23 668 891       | 0,48              |
| 471 802 Brady Corp  | 25 349 921       | 0,52              | 271 068 Johnson & Johnson   | 42 015 540       | 0,86              |
| 245 097 Brown & Brown                                     | 14 073 470       | 0,29              | 452 728 Kimberly-Clark Corp                                       | 60 765 152       | 1,24              |
| 332 188 Brown-Forman                                      | 21 349 723       | 0,43              | 197 017 L3Harris Technologies Inc                                 | 38 662 616       | 0,79              |
| 472 240 California Water Service Group                    | 27 484 368       | 0,56              | 160 601 Lancaster Colony Corp                                     | 32 582 731       | 0,66              |
| 614 479 Cardinal Health Inc                               | 46 393 164       | 0,94              | 2 195 699 Leggett & Platt Inc                                     | 69 998 884       | 1,43              |
| 94 440 Carlisle Cos Inc                                   | 21 350 051       | 0,43              | 199 618 Lincoln Electric Holdings Inc                             | 33 755 404       | 0,69              |
| 53 061 Casey's General Stores Inc                         | 11 485 584       | 0,23              | 97 901 Lockheed Martin Corp                                       | 46 280 740       | 0,94              |
| 138 874 Caterpillar Inc                                   | 31 779 926       | 0,65              | 182 092 Lowe's Cos Inc  | 36 412 937       | 0,74              |
| 479 539 CH Robinson Worldwide Inc                         | 47 651 790       | 0,97              | 427 549 McCormick & Co Inc/MD                                     | 35 576 352       | 0,72              |
| 312 044 Chevron Corp                                      | 50 913 099       | 1,04              | 152 613 McDonald's Corp   | 42 672 121       | 0,87              |
| 117 489 Chubb Ltd   | 22 814 014       | 0,46              | 1 698 280 MDU Resources Group Inc                                 | 51 763 574       | 1,05              |
| 281 153 Church & Dwight Co Inc                            | 24 856 737       | 0,51              | 772 360 Medtronic PLC   | 62 267 663       | 1,27              |
| 455 599 Cincinnati Financial                              | 51 063 536       | 1,04              | 439 767 Microchip Technology Inc                                  | 36 843 679       | 0,75              |
| 41 309 Cintas Corp  | 19 112 848       | 0,39              | 173 991 MSA Safety Inc  | 23 227 799       | 0,47              |
| 425 434 Clorox Co   | 67 320 676       | 1,37              | 904 240 National Fuel Gas Co                                      | 52 210 818       | 1,06              |
| 814 812 Coca-Cola   | 50 542 788       | 1,03              | 1 144 589 New Jersey Resources Corp                               | 60 892 135       | 1,24              |
| 560 258 Colgate-Palmolive                                 | 42 103 389       | 0,86              | 77 955 New Linde PLC  | 27 708 325       | 0,56              |
| 401 086 Commerce Bancshares Inc/MO                        | 23 403 368       | 0,48              | 432 143 NextEra Energy Inc  | 33 309 582       | 0,68              |
| 576 372 Community Bank System Inc                         | 30 253 766       | 0,62              | 163 355 Nike  | 20 033 857       | 0,41              |
| 628 625 Consolidated Edison Inc                           | 60 140 554       | 1,22              | 80 400 Nordson Corp   | 17 869 704       | 0,36              |
| 340 356 Cullen/Frost Bankers Inc                          | 35 853 101       | 0,73              | 1 487 778 Nu Skin Enterprises Inc                                 | 58 484 553       | 1,19              |
| 457 221 Donaldson Co Inc                                  | 29 874 820       | 0,61              | 179 137 Nucor Corp  | 27 671 292       | 0,56              |
| 185 718 Dover Corp  | 28 217 993       | 0,57              | 2 794 416 Old Republic International Corp                         | 69 776 568       | 1,42              |
| 169 228 Ecolab Inc  | 28 012 311       | 0,57              | 738 812 ONE Gas Inc   | 58 536 075       | 1,19              |
| 431 455 Emerson Electric Co                               | 37 596 989       | 0,77              |   |                  |                   |



## SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

| Participation   | Investissement             | Juste valeur USD | % des actifs nets | Participation  | Investissement                  | Juste valeur USD | % des actifs nets |
|---|----------------------------|------------------|-------------------|--|---------------------------------|------------------|-------------------|
| <b>Valeurs mobilières – 99,68 % (mars 2022 : 99,76 %) (suite)</b>   |                            |                  |                   | <b>Valeurs mobilières – 99,68 % (mars 2022 : 99,76 %) (suite)</b>                  |                                 |                  |                   |
| <b>Actions ordinaires – 93,60 % (mars 2022 : 94,00 %) (suite)</b>   |                            |                  |                   | <b>Actions ordinaires – 93,60 % (mars 2022 : 94,00 %) (suite)</b>                  |                                 |                  |                   |
| <b>Dollar américain – 93,60 % (suite)</b>                           |                            |                  |                   | <b>Dollar américain – 93,60 % (suite)</b>  |                                 |                  |                   |
| 692 388   | Pentair PLC                | 38 268 285       | 0,78              | 316 016  | Target                          | 52 341 730       | 1,07              |
| 265 989   | PepsiCo                    | 48 489 795       | 0,99              | 1 754 545  | UGI Corp                        | 60 987 984       | 1,24              |
| 426 775   | Polaris Inc                | 47 214 118       | 0,96              | 380 123  | UMB Financial Corp              | 21 940 700       | 0,45              |
| 268 510   | PPG Industries Inc         | 35 867 566       | 0,73              | 1 617 794  | United Bankshares Inc/WV        | 56 946 349       | 1,16              |
| 303 059   | Procter & Gamble Co        | 45 061 843       | 0,92              | 139 287  | W. R. Berkley                   | 8 672 009        | 0,18              |
| 741 203   | Prosperity Bancshares Inc  | 45 598 809       | 0,93              | 2 552 812  | Walgreens Boots Alliance Inc    | 88 276 239       | 1,80              |
| 74 631  | RenaissanceRe Holdings Ltd | 14 951 575       | 0,30              | 197 237  | Walmart Inc                     | 29 082 596       | 0,59              |
| 106 641   | RLI Corp                   | 14 173 655       | 0,29              | 22 390   | West Pharmaceutical Services    | 7 757 463        | 0,16              |
| 25 226  | Roper Technologies         | 11 116 846       | 0,23              | 38 682   | WV Grainger Inc                 | 26 644 548       | 0,54              |
| 185 158   | Royal Gold Inc             | 24 016 844       | 0,49              | <b>Total des actions ordinaires</b>  |                                 |                  |                   |
| 350 844   | RPM International Inc      | 30 607 631       | 0,62              | <b>4 595 330 607</b>   |                                 |                  |                   |
| 49 207  | S&P Global Inc             | 16 965 097       | 0,35              | <b>Fiducies de placement immobilier de type REIT – 6,08 % (mars 2022 : 5,76 %)</b> |                                 |                  |                   |
| 420 288   | SEI Investments Co         | 24 187 574       | 0,49              | <b>Dollar américain – 6,08 %</b>   |                                 |                  |                   |
| 72 276  | Sherwin-Williams           | 16 245 477       | 0,33              | 338 789  | Essex Property Trust Inc        | 70 854 331       | 1,44              |
| 403 373   | SJW Group                  | 30 708 786       | 0,63              | 691 345  | Federal Realty Investment Trust | 68 325 626       | 1,39              |
| 960 748   | Sonoco Products Co         | 58 605 628       | 1,19              | 1 817 930  | National Retail Properties Inc  | 80 261 610       | 1,64              |
| 1 018 337   | Southern Co                | 70 855 888       | 1,44              | 1 249 402  | Realty Income                   | 79 112 135       | 1,61              |
| 866 857   | Stanley Black & Decker Inc | 69 851 337       | 1,42              | <b>Total des fiducies de placement immobilier de type REIT</b>                     |                                 |                  |                   |
| 191 725   | Stepan Co                  | 19 753 427       | 0,40              | <b>298 553 702</b>   |                                 |                  |                   |
| 585 249   | Sysco Corp                 | 45 198 780       | 0,92              | <b>6,08</b>  |                                 |                  |                   |
| 668 065   | T Rowe Price Group Inc     | 75 424 538       | 1,54              | <b>Total des valeurs mobilières</b>  |                                 |                  |                   |
|   |                            |                  |                   | <b>4 893 884 309</b>   |                                 |                  |                   |
|   |                            |                  |                   | <b>99,68</b>   |                                 |                  |                   |
| <b>Instruments financiers dérivés – 0,10 % (mars 2022 : 0,00 %)</b> |                            |                  |                   |  |                                 |                  |                   |
| <b>Contrats de change à terme – 0,10 % (mars 2022 : (0,01 %))^</b>  |                            |                  |                   |  |                                 |                  |                   |

| Devise achetée  | Devise vendue | Montant acheté | Montant vendu | Date d'échéance | Contrepartie                | Plus-values/ (Moins-values) latentes USD | % du Comp.    |
|---|---------------|----------------|---------------|-----------------|-----------------------------|--|---------------|
| EUR   | USD           | 1 812 770      | 1 964 000     | 04/04/2023      | Morgan Stanley              | 5 483                                    | 0,00          |
| EUR   | USD           | 2 518 122      | 2 695 000     | 04/04/2023      | BNP Paribas                 | 40 814                                   | 0,00          |
| EUR   | USD           | 58 522 639     | 62 186 625    | 04/04/2023      | HSBC Bank                   | 1 395 291                                | 0,03          |
| EUR   | USD           | 58 522 970     | 62 186 625    | 04/04/2023      | Westpac Banking Corporation | 1 395 650                                | 0,03          |
| EUR   | USD           | 58 524 843     | 62 186 625    | 04/04/2023      | Toronto Dominion Bank       | 1 397 685                                | 0,03          |
| EUR   | USD           | 61 744 447     | 65 625 625    | 04/04/2023      | Bank of Montreal            | 1 456 624                                | 0,03          |
| USD   | EUR           | 25 010 000     | 23 529 899    | 04/04/2023      | BNP Paribas                 | (554 056)                                | (0,01)        |
| USD   | EUR           | 8 296 000      | 7 807 544     | 04/04/2023      | Bank of Montreal            | (186 506)                                | (0,01)        |
| USD   | EUR           | 11 248 000     | 10 483 706    | 04/04/2023      | Morgan Stanley              | (142 022)                                | (0,00)        |
| USD   | EUR           | 2 124 000      | 1 993 539     | 04/04/2023      | Standard Chartered Bank     | (41 880)                                 | (0,00)        |
| USD   | EUR           | 2 003 000      | 1 872 958     | 04/04/2023      | Citibank                    | (31 875)                                 | (0,00)        |
| USD   | EUR           | 1 000 000      | 930 154       | 04/04/2023      | UBS AG                      | (10 566)                                 | (0,00)        |
| <b>Plus-values latentes sur contrats de change à terme</b>        |               |                |               |                 |                             | <b>5 691 547</b>                         | <b>0,12</b>   |
| <b>Moins-values latentes sur contrats de change à terme</b>       |               |                |               |                 |                             | <b>(966 905)</b>                         | <b>(0,02)</b> |
| <b>Plus-values latentes nettes sur contrats de change à terme</b> |               |                |               |                 |                             | <b>4 724 642</b>                         | <b>0,10</b>   |

## SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF

### Tableau des investissements au 31 mars 2023 (suite)

Instruments financiers dérivés – 0,10 % (mars 2022 : 0,00 %) (suite)  
Contrats à terme standardisés – 0,00 % (mars 2022 : 0,01 %)

| Montant notionnel | Prix du coût moyen  | Plus-values latentes USD | % des actifs nets |
|-------------------|---|--------------------------|-------------------|
| 7 364 600         | 3 981 37 of S&P 500 E-mini Index Futures Long Contracts Expiring 16 June 2023 | 290 237                  | 0,00              |
|                   | <b>Plus-values latentes nettes sur contrats à terme standardisés</b>          | <b>290 237</b>           | <b>0,00</b>       |
|                   | <b>Total des instruments financiers dérivés</b>                               | <b>5 014 879</b>         | <b>0,10</b>       |

|   | Juste valeur USD     | % du Comp.    |
|---|----------------------|---------------|
| <b>Valeur totale des investissements</b>  | 4 898 899 188        | 99,78         |
| Disponibilités bancaires* (mars 2022 : 0,10 %)                                      | 2 721 462            | 0,06          |
| Liquidités détenues auprès d'un courtier* (mars 2022 : néant)                       | 231 000              | 0,00          |
| Montants à recevoir du courtier (mars 2022 : (0,01 %))                              | -                    | -             |
| Autres actifs nets (mars 2022 : 0,15 %)   | 8 045 631            | 0,16          |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables</b> | <b>4 909 897 281</b> | <b>100,00</b> |

^ Les contrats à terme sont utilisés à des fins de couverture.

\* Tous les avoirs liquides sont détenus auprès de State Street Bank and Trust Company, à l'exception des liquidités détenues auprès d'un courtier, en l'occurrence Goldman Sachs.

Le courtier pour les contrats à terme standardisés ouverts est Goldman Sachs.

Sauf indication contraire, toutes les valeurs mobilières mentionnées ci-dessus sont négociées auprès d'une Bourse de valeurs reconnue ou sur un marché réglementé reconnu.

| Analyse du total des actifs (non auditée)                               | % du total des actifs |
|---|-----------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une Bourse de valeurs | 99,53                 |
| Instruments financiers dérivés négociés en Bourse                       | 0,01                  |
| Instruments financiers dérivés négociés de gré à gré                    | 0,11                  |
| Autres actifs   | 0,35                  |
| <b>Total des actifs</b>   | <b>100,00</b>         |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023

### 1. PRINCIPALES CONVENTIONS COMPTABLES

SSGA SPDR ETFs Europe I plc (la « Société ») a été constituée et immatriculée le 5 janvier 2011 sous le numéro 493329 et opère en Irlande en tant que société à responsabilité limitée de type *public limited company* sous le régime du *Companies Act* de 2014. Elle a été agréée par la Banque centrale d'Irlande (la « Banque centrale ») le 7 mars 2011. Le siège social de la Société est situé 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin D02 HD32, Irlande.

Les principales conventions comptables utilisées pour la préparation de ces états financiers sont définies ci-dessous. Ces méthodes ont été appliquées de manière systématique durant toutes les périodes.

#### (a) Base de la présentation

Les états financiers ont été préparés conformément aux Normes internationales d'information financière (*International Financial Reporting Standards* ou « IFRS ») adoptées par l'Union européenne (« UE »), aux interprétations adoptées par l'International Accounting Standards Board (« IASB ») ainsi qu'à la législation irlandaise comprenant le *Companies Act* et la Réglementation OPCVM.

Les états financiers ont été préparés selon le principe de la continuité d'exploitation, car les Administrateurs estiment que la société peut poursuivre son existence opérationnelle pendant au moins douze mois à compter de la date d'approbation des présents états financiers (« la période d'évaluation ») suivant le principe du coût historique modifié par la revalorisation de certains actifs et passifs financiers (y compris des instruments financiers dérivés) détenus à la juste valeur par le biais du compte de résultat.

Les Administrateurs estiment que les actifs financiers continueront à générer des flux de trésorerie suffisants pour honorer les engagements de la Société à leur échéance. Dans le cadre de cette évaluation, les Administrateurs ont pris en compte l'impact potentiel du conflit russo-ukrainien sur l'activité de la Société au cours de la période d'évaluation.

Les modifications apportées aux principales conventions comptables sont décrites ci-dessous.

#### (b) Normes, amendements et interprétations nouvellement émis

**Normes, amendements et interprétations nouvellement émis, mais non encore effectifs pour l'exercice financier débutant le 1<sup>er</sup> avril 2022** Il n'existe pas de nouvelles normes, interprétations ou amendements des normes actuelles en vigueur qui soient susceptibles d'avoir une incidence significative sur les états financiers de la Société.

**Normes, amendements et interprétations nouvellement émis mais non encore effectifs pour l'exercice financier débutant le 1<sup>er</sup> avril 2022** Les normes, amendements et interprétations nouvellement émis cités à continuation ne sont pas susceptibles d'avoir une incidence significative sur les états financiers de la Société.

Norme IAS 1 Présentation des états financiers et Énoncé de pratique IFRS 2 Formuler une opinion sur l'importance relative. La modification d'IAS 1 consiste à remplacer l'obligation de décrire les « principales méthodes comptables » par une obligation de fournir des informations pertinentes sur les méthodes comptables de l'entité.

Les amendements sont entrés en vigueur pour les périodes annuelles à compter du 1<sup>er</sup> janvier 2023.

Amendements apportés à la Norme IAS 8 – Définition des estimations comptables. Les amendements permettent de préciser comment les sociétés distinguent les modifications apportées aux méthodes comptables de celles apportées aux estimations comptables, en mettant principalement l'accent sur la définition des estimations comptables et les clarifications faites à leur égard. Les amendements sont entrés en vigueur pour les périodes annuelles à compter du 1<sup>er</sup> janvier 2023.

Amendements apportés à la Norme IAS 12 – Impôt différé lié aux actifs et aux passifs découlant d'une transaction unique. Les modifications introduisent une exception à l'exemption de comptabilisation initiale d'IAS 12 et s'appliquent également aux différences temporelles déductibles et différences temporelles imposables liées aux actifs au titre de droits d'utilisation et aux passifs locatifs, ainsi qu'aux passifs relatifs au démantèlement et aux montants correspondants comptabilisés en tant qu'actifs au début de la période comparative présentée la plus récente. Les amendements sont entrés en vigueur pour les périodes annuelles à compter du 1<sup>er</sup> janvier 2023.

Amendements apportés à la Norme IAS 1 – Classification des passifs en tant que passifs courants ou non courants – Le report de la Date d'entrée en vigueur permet d'adopter une approche de classification des passifs plus générale en vertu de la Norme IAS 1 – Présentation des états financiers sur la base des accords contractuels en place à la date d'arrêt des comptes. Les amendements sont entrés en vigueur pour les périodes annuelles à compter du 1<sup>er</sup> janvier 2024.

Modifications d'IAS 7 « État des flux de trésorerie » et d'IFRS 7 « Instruments financiers : informations à fournir : ententes de financement de fournisseurs ». Les modifications consistent à ajouter des obligations d'information et des « indications » dans les obligations existantes, exigeant des entités de fournir des informations qualitatives et quantitatives au sujet des ententes de financement de fournisseurs. Les amendements sont entrés en vigueur pour les périodes considérées à compter du 1<sup>er</sup> janvier 2024.

Il n'existe pas d'autres nouvelles normes, interprétations ou amendements des normes actuelles, n'étant pas encore en vigueur, qui soient susceptibles d'avoir une incidence significative sur les états financiers de la Société.

#### (c) Conversion des devises

##### *Devise fonctionnelle et devise de présentation*

La Société exploite un certain nombre de Compartiments, dont les devises fonctionnelles individuelles sont déterminées distinctement, comme indiqué dans l'État de la situation financière. Les éléments inclus dans les états financiers de la Société sont mesurés en utilisant la devise de l'environnement économique principal dans lequel les Compartiments opèrent. La Société a également adopté ces devises comme devises de présentation des Compartiments individuels. Les totaux de la Société sont présentés en dollar américain (qui est aussi la « devise fonctionnelle »).

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 1. PRINCIPALES CONVENTIONS COMPTABLES (SUITE)

#### (c) Conversion des devises (suite)

##### *Transactions et soldes*

Les transactions en devises étrangères sont converties dans la devise fonctionnelle en utilisant les taux de change en vigueur aux dates des opérations concernées. Les actifs et passifs en devises étrangères sont convertis dans la devise fonctionnelle en utilisant le taux de change en vigueur à la date de l'État de la situation financière. Les plus-values ou moins-values de change résultant de la conversion sont incluses dans l'État du résultat global.

Pour l'établissement de l'État de la situation financière de la Société, les États de la situation financière des Compartiments individuels qui n'utilisent pas la devise de présentation sont convertis en dollar américain en appliquant les taux de change en vigueur au 31 mars 2022 et cumulés pour la préparation des États de la situation financière de la Société. Pour l'établissement de l'État du résultat global de la Société, de l'État des variations des actifs nets attribuables aux Porteurs d'actions de participation rachetables de la Société et de l'État des flux de trésorerie de la Société, basés sur les comptes des Compartiments individuels, les taux de change moyens de l'exercice financier sont utilisés. La combinaison des taux de change moyens et de fin d'exercice dans les différents états donne lieu à une plus-value ou moins-value de conversion nominale dans l'État des variations des actifs nets attribuables aux Porteurs d'Actions de participation rachetables de la Société et l'État des flux de trésorerie de la Société. Ceci ne concerne que la situation de la Société et n'a aucun impact sur la Valeur liquidative (« VL ») attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables.

#### (d) Jugements et estimations comptables significatifs

La préparation des états financiers de la Société exige que la direction procède à des jugements, estimations et hypothèses affectant les montants comptabilisés dans les états financiers. L'incertitude liée à ces hypothèses et estimations peut néanmoins exiger un ajustement important de la valeur comptable de l'actif ou du passif affecté à l'avenir.

##### *Principe de la continuité d'exploitation*

Comme indiqué à la Note 1 (a) et sur la base d'une évaluation des Administrateurs, les états financiers ont été préparés selon le principe de la continuité d'exploitation.

##### *Évaluation à la juste valeur des instruments financiers dérivés (« IFD ») et des titres non cotés sur un marché actif*

Les Compartiments détiennent des instruments financiers qui ne sont pas cotés sur des marchés actifs, y compris les IFD. La juste valeur de ces instruments est déterminée à l'aide de techniques de valorisation et peut être déterminée en utilisant des sources de prix réputées (telles que des agences de cotation des prix) ou des prix indicatifs provenant de teneurs de marché. Les cotations des courtiers obtenues à partir de ces sources peuvent être indicatives et non exécutoires ou contraignantes. Lorsqu'aucune donnée de marché n'est disponible, la Société peut évaluer les positions en utilisant ses propres modèles, qui sont généralement basés sur des méthodes et des techniques de valorisation généralement reconnues comme standard dans le secteur.

Les données d'entrée utilisées pour ces modèles sont relevées sur des marchés observables, lorsque cela est possible. Dans le

cas contraire, un degré de jugement est requis pour établir les justes valeurs. Les jugements incluent des considérations liées à la liquidité et aux données d'entrée des modèles comme le risque de crédit (tant de la Société que de la contrepartie), la corrélation et la volatilité. Toute variation des hypothèses émises à propos de ces facteurs est susceptible d'affecter la juste valeur comptabilisée des instruments financiers. Les modèles utilisés pour déterminer la juste valeur sont validés et périodiquement révisés par le personnel expérimenté du Gestionnaire d'investissement, indépendamment de la partie qui les a créés.

Les modèles utilisent des données observables, dans la mesure du possible. Cependant, les champs tels que le risque de crédit (propre et de contrepartie), les volatilités et les corrélations exigent du Gestionnaire d'investissement qu'il fasse des estimations. Toute variation des hypothèses émises à propos de ces facteurs est susceptible d'affecter les justes valeurs comptabilisées des instruments financiers. Les Compartiments considèrent les données observables comme des données de marché immédiatement disponibles, diffusées et actualisées régulièrement, fiables et vérifiables, non exclusives et fournies par des sources indépendantes activement impliquées sur le marché concerné. Veuillez vous reporter à la Note 1 (e)(iii) pour obtenir de plus amples informations sur l'évaluation à la juste valeur des instruments financiers des Compartiments.

#### (e) Instruments financiers

##### (i) Classification

La Société classe ses investissements en fonction à la fois du modèle d'entreprise de la Société pour la gestion de ces actifs financiers et des caractéristiques contractuelles des flux de trésorerie des actifs financiers. Le portefeuille d'actifs financiers est géré et les performances sont évaluées sur la base de la juste valeur. La Société se concentre principalement sur les informations relatives à la juste valeur et les utilise pour évaluer les performances des actifs et prendre des décisions. La Société n'a pas pris l'option de désigner irrévocablement des titres de capitaux propres comme étant à leur juste valeur par le biais des autres éléments du résultat global. Les flux de trésorerie contractuels des titres de créance de la Société sont uniquement le principal et les intérêts ; cependant, ces titres ne sont ni détenus dans le but de collecter des flux de trésorerie contractuels, ni détenus pour à la fois collecter des flux de trésorerie contractuels et être vendus. La collecte des flux de trésorerie contractuels n'est qu'accessoire à la réalisation de l'objectif du modèle économique de la Société. Par conséquent, tous les investissements sont évalués à leur juste valeur par le biais du compte de résultat.

##### (ii) Comptabilisation, sortie du bilan et évaluation

Les achats réguliers et ventes régulières d'investissements sont comptabilisés à la date de la transaction, c'est-à-dire la date à laquelle le Compartiment s'engage à acheter ou vendre l'investissement. Les actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat sont initialement comptabilisés à la juste valeur. Les coûts de transaction sont imputés au moment où ils sont engagés dans l'État du résultat global ; veuillez vous reporter à la Note 1(I) pour plus d'informations. Les actifs financiers sortis du bilan lorsque les droits à percevoir des flux de trésorerie sur investissements ont expiré ou lorsque le Compartiment a transféré la quasi-totalité des risques et des avantages inhérents à la propriété.

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 1. PRINCIPALES CONVENTIONS COMPTABLES (SUITE)

#### (e) Instruments financiers (suite)

##### (ii) Comptabilisation, sortie du bilan et évaluation (suite)

Les passifs financiers sont décomptabilisés lorsque les obligations à verser des flux de trésorerie à partir des investissements ont été acquittées, annulées ou ont expiré.

Après comptabilisation initiale, tous les actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat sont évalués à la juste valeur. Les plus-values et moins-values découlant des variations de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat sont présentées dans l'État du résultat global au poste « Variations nettes de juste valeur des actifs financiers et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat » pendant la période à laquelle elles se produisent.

Les revenus de dividendes sur les actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat sont constatés dans l'État du résultat global comme revenus de dividendes quand le droit du Compartiment à recevoir des paiements est établi. Les intérêts liés à des titres de créance à la juste valeur par le biais du compte de résultat sont comptabilisés dans l'État du résultat global comme des revenus sur actifs financiers à la juste valeur basés sur le taux d'intérêt effectif.

##### (iii) Estimation de la juste valeur

La Norme IFRS 13 Mesure de la juste valeur (« Norme IFRS 13 ») améliore la cohérence et réduit la complexité en fournissant une définition précise de la juste valeur. Les données de valorisation des actifs et des passifs financiers cotés des Compartiments sont cohérentes avec les données préconisées dans leur document d'offre respectif.

La juste valeur des actifs et passifs financiers négociés sur des marchés actifs (comme les dérivés cotés et les titres négociés) est basée sur les derniers cours cotés à la date de clôture des négociations de la période. Concernant les titres de créance, le cours de marché utilisé pour les actifs financiers détenus par le Compartiment correspond au prix acheteur en cours ; le cours de marché correspondant pour les passifs financiers étant le prix vendeur en cours. Concernant les titres de participation, le cours de marché utilisé est le cours constaté à la clôture.

Lorsque la juste valeur des actifs et passifs financiers enregistrés dans l'État de la situation financière ne peut pas être dérivée de marchés actifs, elle sera évaluée à sa valeur de réalisation probable, estimée avec soin et de bonne foi, par les Administrateurs, en consultation avec l'Agent administratif ou une personne compétente, ou une firme ou société nommée par les Administrateurs et approuvée à cette fin par le Dépositaire. Ces valeurs sont déterminées en utilisant différentes techniques d'évaluation incluant l'utilisation de modèles mathématiques. Les données d'entrée utilisées pour ces modèles sont relevées sur des marchés observables, lorsque cela est possible. Dans le cas contraire, un degré de jugement est requis pour établir les justes valeurs. Les jugements incluent des considérations liées à la liquidité et aux données d'entrée des modèles comme le risque de crédit (de la Société et de la contrepartie), la corrélation et la volatilité.

Toute variation des hypothèses émises à propos de ces facteurs est susceptible d'affecter la juste valeur comptabilisée des instruments financiers. Les modèles sont calibrés régulièrement et testés pour vérifier leur validité à l'aide de prix

provenant de toute transaction observable du marché courant pour le même instrument (sans modification ou réorganisation) ou sur la base de toutes données de marché observables disponibles. Le classement des mesures de la juste valeur à la fin de l'exercice figure dans la Note 12 sous l'intitulé « Hiérarchie des justes valeurs ». Tous les instruments en actions détenus par les Compartiments sont négociés en Bourse et valorisés selon la même méthode que celle décrite précédemment pour les actions.

La Société a adopté deux modèles de gestion :

- un premier modèle de gestion aux termes duquel les actifs sont détenus aux fins d'encaisser les flux de trésorerie contractuels. Ce modèle comprend les liquidités et les créances de la Société ;
- un second modèle de gestion : il s'agit des investissements de la Société dans des titres à revenu fixe, un modèle aux termes duquel lesdits actifs financiers sont gérés, mesurés et valorisés sur la base de la juste valeur, avec des ventes fréquentes.

Les investissements de la Société, tels que les titres à revenu fixe, ne sont ni détenus dans le but de collecter des flux de trésorerie contractuels, ni détenus pour à la fois collecter des flux de trésorerie contractuels et être vendus et, par conséquent, ne satisfont pas au test de modèle d'activité selon la Norme IFRS 9 Instruments financiers (« Norme IFRS 9 »). En tant que telle, la Société classe l'investissement comme un actif financier à la juste valeur par le biais du compte de résultat. Les liquidités et les créances sont détenues au coût amorti avec un modèle simplifié de pertes de crédit attendues, étant donné qu'elles ne contiennent pas de composante financière.

La Norme IFRS 9 impose à la Société de procéder à une évaluation de la dépréciation de ses actifs financiers. Les Administrateurs ont estimé que la dépréciation ne s'applique pas aux actifs financiers classés comme des instruments financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat. En ce qui concerne les actifs détenus au coût amorti, les Administrateurs considèrent que la probabilité de défaut est proche de zéro, puisque ces instruments présentent un faible risque de défaut, et les contreparties ont une forte capacité à s'acquitter de leurs obligations contractuelles à court terme. Par conséquent, aucune correction de valeur pour perte sur les actifs financiers au coût amorti n'a été reconnue dans les états financiers en se fondant sur les pertes de crédit attendues sur la durée de vie, étant donné qu'une telle dépréciation serait totalement négligeable pour la Société.

##### (iv) Instruments spécifiques

###### *Contrats de change à terme et au comptant*

La juste valeur des contrats de change ouverts, à terme et au comptant, est calculée comme la différence entre le taux prévu au contrat et le taux à terme courant qui correspondrait à la clôture du contrat à la date de l'État de la situation financière. Pour chaque Compartiment concerné, les plus-values ou moins-values sur contrats de change au comptant sont incluses dans la trésorerie et les équivalents de trésorerie dans l'État de la situation financière, et les plus-values ou moins-values sur contrats de change à terme ouverts sont incluses dans les actifs financiers (ou passifs financiers) à la juste valeur par le biais du compte de résultat, selon le cas, dans l'État de la situation financière, et présentées dans le Tableau des investissements de chaque Compartiment concerné.

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 1. PRINCIPALES CONVENTIONS COMPTABLES (SUITE)

#### (e) Instruments financiers (suite)

#### (iv) Instruments spécifiques (suite)

##### *Contrats de change à terme et au comptant (suite)*

Toutes les variations de juste valeur sont constatées dans l'État du résultat global.

##### *Contrats à terme standardisés*

Les dépôts de marge initiaux sont réalisés lors de la conclusion de contrats à terme standardisés et prennent généralement la forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie. La juste valeur des contrats à terme standardisés est basée sur leurs cours de règlement cotés quotidiennement. Les variations de la valeur des contrats à terme standardisés ouverts sont comptabilisées comme plus-values ou moins-values latentes sur les contrats à terme standardisés jusqu'à la clôture des contrats, moment auquel les plus-values ou moins-values réalisées sont constatées dans l'État du résultat global.

Les plus-values ou moins-values latentes sur les contrats à terme standardisés ouverts sont incluses dans le Tableau des investissements de chaque Compartiment concerné et dans l'État de situation financière comme actifs financiers ou passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat, selon le cas.

##### *Engagements à communiquer (« TBA », to be announced)*

Les Compartiments peuvent prendre des engagements sur des TBA assortis d'un paiement et d'une livraison à une date ultérieure fixée au-delà de la période de règlement habituelle pour ce titre. Pour les opérations TBA, les titres particuliers devant être livrés ne sont pas identifiés à la date de transaction, mais les titres livrés doivent néanmoins respecter des conditions spécifiées, incluant l'émetteur, le taux et l'échéance hypothécaire, et correspondre aux normes de « livraison satisfaisante » acceptées par le secteur. Jusqu'au règlement, les Compartiments conservent des réserves de liquidités et des actifs liquides suffisants pour régler leurs contrats TBA. Les titres TBA sont achetés et vendus sur une base d'engagement à terme avec un montant principal et une date d'échéance approximatifs. Le montant principal réel et la date d'échéance réelle seront déterminés au moment du règlement une fois les pools hypothécaires spécifiques assignés.

Les revenus issus des titres ne seront pas acquis avant la date de règlement. Les engagements d'achat TBA peuvent être considérés comme des titres en eux-mêmes, et impliquent un risque de perte si la valeur du titre devant être acheté diminue avant la date de règlement, lequel risque s'ajoute au risque de déclin de la valeur d'un autre actif du Compartiment.

Les engagements d'achat TBA, qui sont comptabilisés à titre d'opérations d'achat et de vente, peuvent être considérés comme des titres eux-mêmes et comportent un risque de perte en raison des variations de la valeur du titre avant la date de règlement ainsi que du risque que la contrepartie à l'opération ne s'exécute pas.

Les engagements d'achat TBA non réglés sont valorisés à leur juste valeur. Le contrat est valorisé au prix du marché quotidiennement et la modification de la juste valeur est enregistrée par les Compartiments en tant que gain ou perte non réalisés. En fonction de la conjoncture du marché, le Gestionnaire d'investissement déterminera s'il prend livraison des titres sous-jacents ou s'il cède les engagements d'achat TBA avant le règlement.

Les Compartiments qui détiennent des titres TBA en circulation au 31 mars 2023, qui sont inclus au poste « Instruments financiers dérivés » de l'État de la situation financière, sont énumérés à la section correspondante « Instruments financiers dérivés » du Tableau des investissements.

#### (f) Trésorerie et équivalents de trésorerie

La trésorerie comprend l'encaisse, les dépôts à vue et les découverts bancaires. Les équivalents de trésorerie sont des investissements à court terme, très liquides, facilement convertibles en montants liquides connus et soumis à de faibles variations de leur valeur, et détenus pour répondre à des engagements de liquidités de court terme plus qu'à des fins d'investissement ou autres.

L'encaisse, les dépôts à vue et les découverts bancaires sont évalués à leur valeur nominale, avec les intérêts cumulés, quand ils sont applicables. Les montants en numéraire sont conservés au niveau de la structure à compartiments multiples eu égard aux fonds de souscription et de rachat reçus de la part des investisseurs, ou dus à ces derniers, dans les Compartiments de la Société. Ces comptes sont tenus conformément aux Orientations de la Banque centrale d'Irlande « Fonds à compartiments multiples – comptes numéraires détenant des fonds de souscription, de rachat et des dividendes ». Lesdits comptes de trésorerie sont réputés être des actifs de la Société et de ce fait, tout solde important a été pris en compte dans l'État de la situation financière arrêté au 31 mars 2023 et au 31 mars 2022.

#### (g) Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties ou dus à ces derniers au titre d'IFD ouverts

##### *Liquidités détenues comme garantie pour un courtier*

Les garanties en numéraire fournies par les Compartiments sont identifiées dans l'État de la situation financière comme des liquidités à la juste valeur détenues en garantie auprès d'un courtier et ne sont pas incluses comme une composante de la trésorerie et des équivalents de trésorerie. Pour les garanties non numéraires, si la partie à laquelle la garantie est fournie a le droit, sur la base du contrat ou de la coutume, de vendre ou de réengager la garantie en nantissement, un Compartiment classe ces actifs dans l'État de la situation financière séparément des autres actifs et les identifie comme une garantie donnée en nantissement. Lorsque la partie à laquelle la garantie est fournie n'a pas le droit de la vendre ou de la remettre en gage, une indication concernant la garantie fournie est incluse dans les notes annexes aux états financiers.

##### *Liquidités à recevoir du/à payer au courtier*

Les liquidités à recevoir du/à payer au courtier sont des liquidités de marge détenues par ou à payer aux courtiers au titre de contrats à terme standardisés ouverts ou de produits dérivés et représentent les dépôts de marge de contrats à terme standardisés négociés en Bourse détenus auprès de courtiers.

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 1. PRINCIPALES CONVENTIONS COMPTABLES (SUITE)

#### (g) Liquidités détenues auprès de courtiers et de contreparties ou dus à ces derniers au titre d'IFD ouverts (suite)

##### *Liquidités à recevoir du/à payer au courtier (suite)*

Ce montant est le minimum considéré par les courtiers et les contreparties pour les exigences de garantie et est ainsi soumis à restrictions et déclaré séparément des liquidités non soumises à restrictions dans l'État de situation financière du Compartiment.

Ces montants sont initialement constatés à leur juste valeur puis déclarés au coût amorti. À chaque date de clôture, le Compartiment doit évaluer la provision pour pertes sur les montants dus par le courtier à un montant égal à la durée de vie des pertes de crédit attendues si le risque de crédit a augmenté de manière significative depuis la comptabilisation initiale. Si, à la date de clôture, le risque de crédit n'a pas considérablement augmenté depuis la comptabilisation initiale, le Compartiment évaluera la provision pour dépréciation à hauteur d'un montant égal à des pertes de crédit attendues sur 12 mois.

D'importantes difficultés financières du courtier, un risque que le courtier dépose le bilan ou procède à un assainissement financier et enregistre des incidents de paiement sont tous des éléments indiquant qu'une provision pour dépréciation pourrait être nécessaire. Si le risque de crédit augmente au point que l'on considère que le crédit est compromis, les revenus d'intérêts seront calculés sur la base de la valeur comptable brute ajustée de la provision pour pertes. Une augmentation significative du risque de crédit est définie par l'administration comme tout paiement contractuel en souffrance depuis plus de 30 jours. Tout paiement contractuel en souffrance depuis plus de 90 jours est considéré comme un crédit compromis.

#### (h) Actions de participation rachetables

Les actions de participation rachetables sont rachetables au gré du détenteur et classifiées en tant que passifs financiers, conformément à la Norme IAS 32 – Instruments financiers : Présentation (« IAS 32 »).

Aux fins du calcul des actifs nets attribuables aux Actionnaires conformément aux exigences de rachat d'un Compartiment, les actifs et passifs de chaque Fonds sont valorisés sur la base de la méthode d'évaluation de l'Indice du Fonds concerné (les « cours de négociation »). Les Compartiments émettent des actions à la VL des actions existantes sur la base des cours de négociation.

Conformément au Prospectus, les porteurs d'actions de participation peuvent les racheter en contrepartie d'une somme égale à une part proportionnelle de la VL du Compartiment concerné (calculée conformément aux exigences applicables en matière de rachat) le Jour de négociation concerné.

La VL par action de chaque Compartiment est calculée en divisant les actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables (calculée conformément aux exigences liées au rachat) par le nombre d'actions en circulation.

#### (i) Plus-values/(Moins-values) latentes et réalisées sur investissements

En ce qui concerne chaque type d'instrument classé en tant qu'instrument financier à la juste valeur par le biais du compte de résultat, les variations des plus-values/(moins-values) latentes et réalisées sont incluses dans les variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat dans l'État du résultat global de chaque Compartiment.

Les plus-values et moins-values réalisées sur la cession d'instruments financiers classés comme des instruments financiers « à la juste valeur par le biais du compte de résultat » sont calculées en utilisant la méthode du coût moyen. Elles représentent la différence entre la valeur comptable initiale de l'instrument et le montant de la cession, ou les montants en numéraire payés ou reçus pour des contrats sur dérivés (excluant les montants en numéraire payés ou reçus sur les comptes de marge en garantie pour ces instruments).

#### (j) Produits de dividendes

Les revenus de dividendes sont portés au crédit dans l'État du résultat global aux dates auxquelles les titres concernés sont cotés comme « ex-dividende ». Les revenus de dividendes sont indiqués bruts de toutes retenues d'impôt non-recouvrables, lesquelles sont indiquées séparément dans l'État de résultat global, et nets de tous crédits d'impôt.

Les revenus de dividendes sur les actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat sont constatés dans l'État du résultat global comme revenus de dividendes quand le droit des Compartiments à recevoir des paiements est établi.

#### (k) Revenus sur actifs financiers à la juste valeur et charges d'intérêts

Les revenus sur actifs financiers à la juste valeur et les charges d'intérêts sont constatés dans l'État du résultat global pour tous les instruments porteurs d'intérêts en utilisant la méthode du taux d'intérêt effectif. Les intérêts liés à des titres de créance à la juste valeur par le biais du compte de résultat sont comptabilisés dans l'État du résultat global comme des revenus sur actifs financiers à la juste valeur basés sur le taux d'intérêt effectif.

La méthode du taux d'intérêt effectif est une méthode visant à calculer le coût amorti d'un actif financier ou d'un passif financier et à imputer les revenus d'intérêts ou les charges d'intérêts sur la période correspondante.

Le taux d'intérêt effectif est le taux qui permet d'actualiser exactement les décaissements ou encaissements de trésorerie futurs estimés durant toute la durée de vie prévue de l'instrument financier, ou, quand ceci s'avère approprié, une période financière plus courte, de manière à obtenir le montant comptable net de l'actif ou du passif financier.

Le rendement négatif sur les actifs financiers, qui correspond à l'intérêt provenant d'un taux d'intérêt réel négatif sur un élément d'actif financier, est ajusté chaque jour et constaté dans le compte de résultat pendant la durée de vie de l'instrument sous-jacent.

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 1. PRINCIPALES CONVENTIONS COMPTABLES (SUITE)

#### (k) Revenus sur actifs financiers à la juste valeur et charges d'intérêts (suite)

Lorsqu'il calcule le taux d'intérêt effectif, le Compartiment estime les flux de trésorerie en prenant en compte toutes les conditions contractuelles de l'instrument financier, mais en n'incluant pas les pertes de crédit futures. Le calcul inclut l'ensemble des commissions et points de pourcentage payé(e)s ou reçu(e)s entre les parties contractantes constituant une partie intégrante du taux d'intérêt effectif, des coûts de transaction et des autres primes ou escomptes.

#### (l) Charges

Les charges sont imputées dans l'État du résultat global. Les coûts de transaction encourus lors de l'acquisition d'un investissement, qui sont inclus dans le coût de cet investissement, ne peuvent pas être identifiés séparément et sont inclus dans les variations nettes de juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat dans l'État du résultat global. Les dépenses résultant de la cession d'investissements sont déduites des produits de la cession et sont incluses dans les variations nettes de juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat dans l'État du résultat global.

Les frais de transaction sont des coûts supplémentaires directement attribuables à l'acquisition, à l'émission ou à la cession d'un actif ou passif financier. Un coût supplémentaire est un coût qui n'aurait pas été encouru si l'entité n'avait pas acquis, émis ou cédé l'instrument financier. Lors de la comptabilisation initiale d'un actif ou passif financier, une entité le mesurera à sa juste valeur par le biais du compte de résultat, plus les frais de transaction directement attribuables à l'acquisition ou à l'émission de l'actif ou du passif financier.

Les frais de transaction sur les acquisitions et ventes d'obligations, les titres TBA et les contrats de change à terme sont inclus dans le prix d'achat et de vente de l'investissement et ne sont pas identifiables de manière séparée. Les frais de transaction sur les acquisitions et ventes d'actions, de droits, de bons de souscription et des contrats à terme standardisés sont inclus dans les variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat dans l'État du résultat global, et indiqués à la Note 4. Les frais de transaction sur les acquisitions et ventes incluent les frais de courtage, les commissions, les impôts associés aux transactions et les autres frais de marché identifiables.

Les coûts de transaction inhérents à la conservation incluent les coûts de transaction payés au Dépositaire et font partie intégrante des pourcentages du TFE, indiqués en Note 3.

#### (m) Montants à recevoir

Les sommes à recevoir sont des actifs financiers non dérivés, assortis de paiements fixes ou déterminables, et qui ne sont pas cotés sur un marché actif.

Les montants à recevoir sont initialement comptabilisés à leur juste valeur augmentée des frais de transaction qui sont directement imputables à leur acquisition ou à leur création. Ils sont ensuite évalués au coût amorti, en suivant la méthode du taux d'intérêt effectif diminué des provisions pour dépréciation.

#### (n) Montants à payer

Les sommes à payer sont initialement comptabilisées à leur juste valeur puis déclarées au coût amorti. La différence entre les produits et les sommes à payer est comptabilisée sur la période financière du montant payable en utilisant la méthode du taux d'intérêt effectif.

Les fournisseurs et autres comptes créditeurs sont payables à diverses dates au cours des trois prochains mois, conformément aux conditions de crédit habituelles et spécifiques des fournisseurs.

#### (o) Distributions

Les distributions avec une date de détachement du dividende comprise dans l'exercice financier considéré sont comptabilisées comme des charges financières dans l'État du résultat global. Le réinvestissement de la distribution, le cas échéant, dont le montant correspond à la part totale de dividendes réinvestie, est comptabilisé comme une opération sur actions dans l'État des variations des actifs nets attribuables aux porteurs d'Actions de participation rachetables.

#### (p) Fiscalité

Les plus-values, les dividendes et les intérêts reçus peuvent être soumis à des impôts sur les plus-values et à une retenue fiscale à la source dans le pays d'origine. Ces charges fiscales peuvent ne pas être récupérables par la Société ou ses Actionnaires. Ces charges fiscales sont incluses dans l'État du résultat global.

#### (q) Reporting par segment

Les segments opérationnels sont présentés conformément aux règles de reporting interne utilisées par le principal décideur opérationnel. Le principal décideur opérationnel, responsable de l'allocation des ressources et de l'évaluation de la performance des segments opérationnels, a été identifié comme étant les Administrateurs.

#### (r) Compensation

Les actifs et passifs financiers sont compensés et le montant net est présenté dans l'État de la situation financière uniquement lorsqu'il existe d'une part, un droit juridiquement exécutoire de compenser les montants constatés et, d'autre part, une intention d'effectuer le règlement sur une base nette, ou de réaliser les actifs et régler les passifs simultanément.

#### (s) Péréquation des revenus

Les Administrateurs peuvent déterminer si la Société, pour le compte de toute catégorie d'actions de distribution des Compartiments, utilise une technique comptable connue sous le nom de péréquation des revenus afin d'éviter la dilution des bénéfices courants des Actionnaires. Ceci est réalisé en appliquant une partie du produit des actions émises et rachetées, qui équivaut au montant par action des revenus d'investissements nets non distribué à la date de la transaction. Les montants répartis sont crédités ou imputés aux revenus non distribués. En conséquence, les distributions des catégories d'actions seront protégées contre les distorsions potentielles que causent les émissions ou les rachats d'actions. La péréquation des revenus est comptabilisée dans les états financiers de l'État du résultat global. La péréquation des revenus est applicable aux catégories d'actions de distribution de tous les Compartiments.



## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 2. FISCALITÉ

La Société est un organisme de placement qualifié selon les termes de la section 739B du *Taxes Consolidation Act* de 1997, tel qu'amendé. En vertu des lois et des pratiques irlandaises courantes, la Société n'est pas tenue de payer d'impôts sur ses revenus et ses plus-values, excepté en cas d'événement imposable. Généralement, un événement imposable résulte de toute distribution, tout rachat, toute annulation ou tout transfert d'actions ou survient à la fin d'une « Période concernée ». Une « Période concernée » est une période de huit ans commençant avec l'acquisition des actions par le porteur d'actions et chaque période suivante de huit ans commençant immédiatement après la Période concernée précédente.

Un événement imposable ne comprend pas :

- i) les transactions en rapport avec des actions détenues dans un système de compensation reconnu, tel que désigné sur ordre des autorités fiscales irlandaises (*Revenue Commissioners of Ireland*) ; ou
- ii) un échange d'actions représentant un Compartiment pour un autre Compartiment de la Société ; ou
- iii) un échange d'actions à l'occasion d'une fusion ou d'un regroupement de la Société avec un autre Fonds ; ou
- iv) certains échanges d'actions entre conjoints et ex-conjoints.

La Société ne sera pas soumise à l'impôt irlandais en cas d'événements imposables dans les situations suivantes :

- i) Un Actionnaire qui ne relève pas du statut de résident irlandais ou dont la résidence fiscale habituelle ne se situe pas en Irlande au moment de l'événement imposable, sous réserve que la Société soit en possession des déclarations légales et requises conformément au *Taxes Consolidation Act* de 1997, dans sa version modifiée ;
- ii) Certains investisseurs résidents irlandais exonérés qui ont remis à la Société les déclarations réglementaires signées nécessaires ; ou
- iii) Toute transaction (qui pourrait être, dans tout autre cas, considérée comme un événement imposable) afférente aux actions détenues dans un système de compensation reconnu, désigné sur ordre des autorités fiscales irlandaises (*Irish Revenue Commissioners*).

Les revenus de dividendes, intérêts et plus-values (le cas échéant) perçus sur les investissements réalisés par la Société peuvent être soumis à des retenues d'impôt à la source imposées par le pays dans lequel les revenus/plus-values de l'investissement sont perçus et ces charges fiscales peuvent ne pas être récupérables par la Société ou ses Actionnaires.

### 3. COMMISSIONS ET FRAIS

Les commissions et frais à payer par un Compartiment sont intégralement réglés sous forme de commission unique. Il s'agit du « Total des frais sur encours » ou TFE. Le TFE n'inclut pas les coûts et charges extraordinaires, ni certains coûts de transaction.

Après déduction et paiement des commissions et indemnités des Administrateurs et des commissaires aux comptes, (qui sont inclus dans le TFE), le solde du TFE est versé au Gestionnaire d'investissement, qui est alors responsable du paiement de toutes les charges opérationnelles de la Société. Ceci inclut, entre autres, les commissions et frais du Gestionnaire d'investissement, du Dépositaire, de l'Agent administratif, de l'Agent de transfert et du Secrétaire de la Société. Le Gestionnaire d'investissement peut payer une partie ou la totalité de ses commissions à toute personne investissant dans ou fournissant des services à la Société ou concernant tout Compartiment.

Le Gestionnaire d'investissement sera aussi responsable du paiement des commissions et frais suivants :

- i) le coût de l'établissement et du maintien d'une inscription des actions à la cote d'une Bourse de valeurs ;
- ii) le coût de la convocation et de la tenue des réunions des Administrateurs et des assemblées des Actionnaires ;
- iii) les honoraires professionnels et débours liés aux services juridiques et autres services de conseil ;
- iv) les coûts et charges résultant de la préparation, de l'impression, de la publication et de la diffusion des prospectus, suppléments, rapports annuels et semestriels et autres documents pour les Actionnaires existants et potentiels ;
- v) les coûts et charges résultant de toute commission de licence ou autre payable à tout fournisseur d'indice ou autre donneur de licence de propriété intellectuelle, marque de commerce ou marque de service utilisée par la Société ;
- vi) les coûts et charges de tout conseiller d'investissement nommé par le Gestionnaire d'investissement ; et
- vii) tous autres coûts et charges (excluant les coûts et charges non récurrents et extraordinaires) pouvant ponctuellement survenir et ayant été approuvés par les Administrateurs comme nécessaires ou justifiés pour la continuité d'exploitation de la Société ou des Compartiments.

Le TFE est calculé et cumulé chaque jour sur la base de la VL de chaque Compartiment et payable mensuellement à terme échu. Le TFE annuel de chaque Compartiment de la Société est indiqué dans le tableau figurant en page suivante. Si les frais d'un Compartiment dépassent le TFE indiqué ci-dessous eu égard à l'exploitation des Compartiments, le Gestionnaire d'investissement couvrira toute insuffisance sur ses propres actifs.

Les honoraires d'audit pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (y compris les dépenses) s'élèvent à 308 000 EUR (31 mars 2022 : 302 400 EUR) net de TVA. Ces frais sont payés à partir du TFE présenté ci-dessous. Aucune commission pour d'autres services de sécurité, services de conformité et sécurité fiscale et autres services hors du périmètre d'audit n'a été versée à Ernst & Young pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (31 mars 2022 : néant).

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 3. COMMISSIONS ET FRAIS (SUITE)

Les commissions des Administrateurs pour l'exercice financier au 31 mars 2023 s'élèvent à 128 510 USD (31 mars 2022 : 142 496 USD), le montant dû aux Administrateurs à la clôture de l'exercice financier était de 11 679 USD (31 mars 2022 : néant USD) et payés sur le TFE indiqué ci-après. Les

honoraires des Administrateurs correspondent au total des rétributions qui leur sont versées ou qu'ils reçoivent au titre de certains services.

| Compartiment   | 31 mars 2023     | 31 mars 2022     |
|--|------------------|------------------|
|  | TFE annuel, en % | TFE annuel, en % |
| SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF                            | 0,20 %           | 0,20 %           |
| SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF                            | 0,12 %           | 0,12 %           |
| SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF - Couvert en MXN                       | 0,10 %           | 0,10 %           |
| SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF - Non couvert en USD                   | 0,10 %           | 0,10 %           |
| SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF                           | 0,15 %           | 0,15 %           |
| SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF                             | 0,15 %           | 0,15 %           |
| SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF                           | 0,12 %           | 0,12 %           |
| SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF - Couvert en EUR (Acc)      | 0,60 %           | 0,60 %           |
| SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF - Non couvert en USD (Acc)  | 0,55 %           | 0,55 %           |
| SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF - Non couvert en USD (Dist) | 0,55 %           | 0,55 %           |
| SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF                                     | 0,17 %           | 0,17 %           |
| SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF - Non couvert en EUR (Acc)         | 0,10 %           | 0,10 %           |
| SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF - Non couvert en EUR (Dist)        | 0,15 %           | 0,15 %           |
| SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF                                    | 0,40 %           | 0,40 %           |
| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF - Couvert en CHF                  | 0,10 %           | 0,10 %           |
| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF - Couvert en EUR (Acc)*           | 0,10 %           | -                |
| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF - Couvert en EUR (Dist)           | 0,10 %           | 0,10 %           |
| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF - Couvert en GBP                  | 0,10 %           | 0,10 %           |
| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF - Couvert en USD (Acc)            | 0,10 %           | 0,10 %           |
| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF - Couvert en USD (Dist)           | 0,10 %           | 0,10 %           |
| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF - Non couvert en USD              | 0,10 %           | 0,10 %           |
| SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF   | 0,17 %           | 0,17 %           |
| SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF                                      | 0,15 %           | 0,15 %           |
| SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF                                     | 0,19 %           | 0,19 %           |
| SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF                                 | 0,15 %           | 0,15 %           |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 3. COMMISSIONS ET FRAIS (SUITE)

|  | 31 mars 2023     | 31 mars 2022     |
|--|------------------|------------------|
| Compartiment   | TFE annuel, en % | TFE annuel, en % |
| SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF - Couvert en EUR                | 0,20 %           | 0,20 %           |
| SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF - Non couvert en USD            | 0,15 %           | 0,15 %           |
| SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF - Couvert en EUR     | 0,35 %           | 0,30 %           |
| SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF - Non couvert en USD | 0,30 %           | 0,30 %           |
| SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF - Non couvert en USD (Acc)           | 0,40 %           | 0,40 %           |
| SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF - Non couvert en USD (Dist)          | 0,40 %           | 0,40 %           |
| SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF                                | 0,30 %           | 0,30 %           |
| SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF - Non couvert en GBP (Acc)                    | 0,20 %           | 0,20 %           |
| SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF - Non couvert en GBP (Dist)                   | 0,20 %           | 0,20 %           |
| SPDR MSCI ACWI UCITS ETF - Couvert en EUR  | 0,45 %           | 0,45 %           |
| SPDR MSCI ACWI UCITS ETF - Couvert en USD  | 0,45 %           | 0,45 %           |
| SPDR MSCI ACWI UCITS ETF - Non couvert en USD                                    | 0,40 %           | 0,40 %           |
| SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF  | 0,55 %           | 0,55 %           |
| SPDR MSCI EMU UCITS ETF  | 0,18 %           | 0,18 %           |
| SPDR MSCI Japan UCITS ETF - Couvert en EUR                                       | 0,17 %           | 0,17 %           |
| SPDR MSCI Japan UCITS ETF - Non couvert en JPY                                   | 0,12 %           | 0,12 %           |
| SPDR MSCI World UCITS ETF  | 0,12 %           | 0,12 %           |
| SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF  | 0,30 %           | 0,30 %           |
| SPDR S&P 500 ESG Screened UCITS ETF**  | 0,10 %           | 0,10 %           |
| SPDR S&P 500 UCITS ETF - Couvert en EUR  | 0,12 %           | 0,12 %           |
| SPDR S&P 500 UCITS ETF - Non couvert en USD                                      | 0,09 %           | 0,09 %           |
| SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF  | 0,35 %           | 0,35 %           |
| SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF                         | 0,55 %           | 0,55 %           |
| SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF                                     | 0,30 %           | 0,30 %           |
| SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF                                   | 0,45 %           | 0,45 %           |
| SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF                                 | 0,55 %           | 0,55 %           |
| SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF                                     | 0,30 %           | 0,30 %           |
| SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF - Couvert en EUR                    | 0,40 %           | 0,40 %           |
| SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF - Non couvert en USD                | 0,35 %           | 0,35 %           |

\* La catégorie d'actions a été lancée le 9 janvier 2023.

\*\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

### 4. FRAIS DE TRANSACTION

Comme mentionné à la Note 1, les frais de transaction sont des coûts supplémentaires directement attribuables à l'acquisition, à l'émission ou à la cession d'un actif ou passif financier.

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 4. FRAIS DE TRANSACTION (SUITE)

Les frais de transaction sur les acquisitions et ventes incluent les frais de courtage, les commissions, les impôts associés aux transactions et les autres frais de marché identifiables. Ces frais de transaction sur les acquisitions et ventes incluent les frais de transaction sur les acquisitions et ventes d'actions, d'instruments en actions et de contrats à terme standardisés. Les coûts de transaction inhérents à la conservation incluent les coûts de transaction payés au Dépositaire et aux Teneurs de compte-conservateurs délégués et font partie intégrante des pourcentages du TFE indiqués en Note 3.

Les Compartiments qui ont supporté des frais d'opération sur les acquisitions et ventes pour l'exercice financier clôturé au 31 mars 2023 et au 31 mars 2022 sont indiqués ci-dessous :

| Compartiment   | 31 mars 2023  | 31 mars 2022  |
|--|---------------|---------------|
| SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF     | 1 262 825 USD | 795 515 USD   |
| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF           | 2 793 USD     | 4 548 USD     |
| SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF              | 59 833 USD    | 64 752 USD    |
| SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF        | 9 588 EUR     | 9 391 EUR     |
| SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF                       | 442 690 GBP   | 245 874 GBP   |
| SPDR MSCI ACWI UCITS ETF                                 | 394 517 USD   | 502 009 USD   |
| SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF                              | 206 192 USD   | 492 412 USD   |
| SPDR MSCI EMU UCITS ETF                                  | 32 991 EUR    | 49 707 EUR    |
| SPDR MSCI Japan UCITS ETF                                | 1 137 810 JPY | 2 200 927 JPY |
| SPDR MSCI World UCITS ETF                                | 362 643 USD   | 257 179 USD   |
| SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF                      | 55 205 USD    | 34 874 USD    |
| SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF*                      | 23 073 USD    | 10 498 USD    |
| SPDR S&P 500 UCITS ETF                                   | 105 303 USD   | 38 184 USD    |
| SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF                    | 17 230 USD    | 17 101 USD    |
| SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF | 351 506 USD   | 285 167 USD   |
| SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF             | 1 045 511 EUR | 1 303 317 EUR |
| SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF           | 1 378 793 USD | 1 011 706 USD |
| SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF         | 121 459 USD   | 238 928 USD   |
| SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF             | 542 004 GBP   | 341 391 GBP   |
| SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF             | 522 376 USD   | 304 399 USD   |

\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

### 5. CAPITAL SOCIAL

Le capital social autorisé de la Société est de 500 000 000 002 (cinq cents milliards et deux) actions sans valeur nominale divisées en deux actions de fondateur sans valeur nominale et 500 000 000 000 (cinq cents milliards) d'actions sans valeur nominale. Les Administrateurs sont habilités à émettre toutes les actions de la Société dans les conditions qu'ils jugent appropriées.

Les actions de fondateur donnent aux porteurs le droit de participer et de voter aux assemblées générales de la Société, mais ne les rendent pas éligibles à participer aux bénéfices ou actifs de la Société, excepté en cas de restitution du capital lors d'une dissolution. Les actions de fondateur ne font pas partie des actifs nets des Compartiments ou de la Société et ne sont présentées que par le biais des présentes notes aux états financiers.

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 5. CAPITAL SOCIAL (SUITE)

Les Actions (autres que les actions de fondateur) donnent aux porteurs le droit de participer et de voter aux assemblées générales de la Société, et de participer à part égale (sous réserve de toute différence entre les commissions, charges et dépenses applicables aux différentes Catégories) aux bénéfices et actifs du Compartiment auxquels se rapportent les Actions.

Les transactions portant sur le capital social (nombre d'actions) des Compartiments au titre de l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 et de l'exercice financier clôturé le 31 mars 2022, étaient les suivantes :

| <b>SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF</b> | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|--|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier      | 58 591 399              | 66 476 099              |
| Souscriptions  | 29 133 350              | 29 576 000              |
| Rachats  | (26 133 000)            | (37 460 700)            |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier      | 61 591 749              | 58 591 399              |

| <b>SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF</b> | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|--|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier      | 2 550 083               | 1 430 083               |
| Souscriptions  | 2 735 500               | 1 587 000               |
| Rachats  | (1 540 000)             | (467 000)               |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier      | 3 745 583               | 2 550 083               |

| <b>SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF<br/>Couvert en MXN</b> | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|---|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier             | 113 765                 | 116 765                 |
| Souscriptions   | 33 600                  | 39 500                  |
| Rachats   | (51 400)                | (42 500)                |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier             | 95 965                  | 113 765                 |

| <b>SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF<br/>Non couvert en USD</b> | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|---|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier                 | 1 015 397               | 3 901 661               |
| Souscriptions   | 2 927 372               | 418 207                 |
| Rachats   | (1 557 605)             | (3 304 471)             |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier                 | 2 385 164               | 1 015 397               |

| <b>SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF</b> | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|---|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier       | 13 837 093              | 22 840 593              |
| Souscriptions   | 5 067 250               | 3 833 500               |
| Rachats   | (6 290 000)             | (12 837 000)            |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier       | 12 614 343              | 13 837 093              |

| <b>SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF</b> | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|---|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier     | 2 840 467               | 2 765 467               |
| Souscriptions   | 4 601 000               | 2 576 000               |
| Rachats   | (5 472 000)             | (2 501 000)             |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier     | 1 969 467               | 2 840 467               |

| <b>SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF</b> | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|---|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier       | 2 295 867               | 2 154 867               |
| Souscriptions   | 5 307 463               | 563 000                 |
| Rachats   | (2 089 000)             | (422 000)               |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier       | 5 514 330               | 2 295 867               |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 5. CAPITAL SOCIAL (SUITE)

**SPDR Bloomberg Emerging Markets  
Local Bond UCITS ETF  
Couvert en EUR**

|   | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|---|-----------------|-----------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 9 893 480       | 4 001 680       |
| Souscriptions   | 4 380 313       | 9 075 741       |
| Rachats   | (6 996 861)     | (3 183 941)     |

|   |           |           |
|---|-----------|-----------|
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 7 276 932 | 9 893 480 |
|---|-----------|-----------|

**SPDR Bloomberg Emerging Markets  
Local Bond UCITS ETF  
Non couvert en USD (Acc)**

|   | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|---|-----------------|-----------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 12 595 782      | 10 824 842      |
| Souscriptions   | 3 555 548       | 7 536 434       |
| Rachats   | (8 290 670)     | (5 765 494)     |

|   |           |            |
|---|-----------|------------|
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 7 860 660 | 12 595 782 |
|---|-----------|------------|

**SPDR Bloomberg Emerging Markets  
Local Bond UCITS ETF  
Non couvert en USD (Dist)**

|   | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|---|-----------------|-----------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 38 936 843      | 45 051 815      |
| Souscriptions   | 16 624 359      | 13 686 213      |
| Rachats   | (17 287 194)    | (19 801 185)    |

|   |            |            |
|---|------------|------------|
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 38 274 008 | 38 936 843 |
|---|------------|------------|

**SPDR Bloomberg Euro Aggregate  
Bond UCITS ETF**

|   | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|---|-----------------|-----------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 9 111 582       | 9 105 982       |
| Souscriptions   | 3 339 000       | 3 445 600       |
| Rachats   | (3 530 000)     | (3 440 000)     |

|   |           |           |
|---|-----------|-----------|
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 8 920 582 | 9 111 582 |
|---|-----------|-----------|

**SPDR Bloomberg Euro Government  
Bond UCITS ETF  
Non couvert en EUR (Acc)**

|   | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|---|-----------------|-----------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 20 153 720      | 17 202 824      |
| Souscriptions   | 12 653 688      | 3 592 898       |
| Rachats   | (1 878 025)     | (642 002)       |

|   |            |            |
|---|------------|------------|
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 30 929 383 | 20 153 720 |
|---|------------|------------|

**SPDR Bloomberg Euro Government  
Bond UCITS ETF  
Non couvert en EUR (Dist)**

|   | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|---|-----------------|-----------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 8 766 463       | 12 276 850      |
| Souscriptions   | 3 216 880       | 4 419 809       |
| Rachats   | (6 676 007)     | (7 930 196)     |

|   |           |           |
|---|-----------|-----------|
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 5 307 336 | 8 766 463 |
|---|-----------|-----------|

**SPDR Bloomberg Euro High Yield  
Bond UCITS ETF**

|   | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|---|-----------------|-----------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 10 297 016      | 16 926 166      |
| Souscriptions   | 12 141 000      | 9 846 350       |
| Rachats   | (13 685 100)    | (16 475 500)    |

|   |           |            |
|---|-----------|------------|
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 8 752 916 | 10 297 016 |
|---|-----------|------------|

**SPDR Bloomberg Global Aggregate  
Bond UCITS ETF  
Couvert en CHF**

|   | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|---|-----------------|-----------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 4 580 575       | 3 819 457       |
| Souscriptions   | 25 069 579      | 1 582 924       |
| Rachats   | (1 485 082)     | (821 806)       |

|   |            |           |
|---|------------|-----------|
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 28 165 072 | 4 580 575 |
|---|------------|-----------|

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 5. CAPITAL SOCIAL (SUITE)

**SPDR Bloomberg Global Aggregate  
Bond UCITS ETF  
Couvert en EUR**

|   | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|---|-----------------|-----------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 7 535 413       | 5 950 808       |
| Souscriptions   | 15 606 687      | 3 339 956       |
| Rachats   | (8 400 509)     | (1 755 351)     |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 14 741 591      | 7 535 413       |

**SPDR Bloomberg Global Aggregate  
Bond UCITS ETF  
Couvert en GBP**

|   | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|---|-----------------|-----------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 905 697         | 2 653 407       |
| Souscriptions   | 1 115 200       | 728 471         |
| Rachats   | (726 012)       | (2 476 181)     |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 1 294 885       | 905 697         |

**SPDR Bloomberg Global Aggregate  
Bond UCITS ETF  
Couvert en USD (Acc)**

|   | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|---|-----------------|-----------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 3 726 720       | 3 957 692       |
| Souscriptions   | 3 432 873       | 1 774 391       |
| Rachats   | (2 991 901)     | (2 005 363)     |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 4 167 692       | 3 726 720       |

**SPDR Bloomberg Global Aggregate  
Bond UCITS ETF  
Couvert en USD (Dist)**

|   | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|---|-----------------|-----------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 29 859 785      | 29 684 680      |
| Souscriptions   | 853 396         | 996 154         |
| Rachats   | (665 230)       | (821 049)       |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 30 047 951      | 29 859 785      |

**SPDR Bloomberg Global Aggregate  
Bond UCITS ETF  
Non couvert en USD**

|   | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|---|-----------------|-----------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 15 740 029      | 13 028 517      |
| Souscriptions   | 11 101 124      | 8 022 377       |
| Rachats   | (13 901 990)    | (5 310 865)     |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 12 939 163      | 15 740 029      |

**SPDR Bloomberg Global Aggregate  
Bond UCITS ETF  
Couvert en EUR (Acc)\***

|   | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|---|-----------------|-----------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | -               | -               |
| Souscriptions   | 428 535         | -               |
| Rachats   | (151 878)       | -               |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 276 657         | -               |

\* La catégorie d'actions a été lancée le 9 janvier 2023, il n'y a donc pas de comparatif disponible.

**SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS  
ETF**

|   | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|---|-----------------|-----------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 12 348 900      | 14 335 900      |
| Souscriptions   | 5 667 700       | 6 803 000       |
| Rachats   | (5 975 000)     | (8 790 000)     |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 12 041 600      | 12 348 900      |

**SPDR Bloomberg U.S. Treasury  
Bond UCITS ETF**

|   | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|---|-----------------|-----------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 4 948 446       | 4 342 446       |
| Souscriptions   | 2 841 000       | 2 034 500       |
| Rachats   | (2 845 000)     | (1 428 500)     |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 4 944 446       | 4 948 446       |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 5. CAPITAL SOCIAL (SUITE)

| <b>SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF</b>     | <b>31 mars 2023</b> | <b>31 mars 2022</b> |
|---|---------------------|---------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 984 376             | -                   |
| Souscriptions   | 83 000              | 1 174 376           |
| Rachats   | (388 334)           | (190 000)           |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 679 042             | 984 376             |

| <b>SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF</b> | <b>31 mars 2023</b> | <b>31 mars 2022</b> |
|---|---------------------|---------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 2 475 700           | 3 030 000           |
| Souscriptions   | 1 542 000           | 1 952 700           |
| Rachats   | (1 232 000)         | (2 507 000)         |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 2 785 700           | 2 475 700           |

| <b>SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF Couvert en EUR</b> | <b>31 mars 2023</b> | <b>31 mars 2022</b> |
|--|---------------------|---------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier                | 9 076 920           | -                   |
| Souscriptions  | 2 513 002           | 9 355 261           |
| Rachats  | (1 237 367)         | (278 341)           |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier                | 10 352 555          | 9 076 920           |

| <b>SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF Non couvert en USD</b> | <b>31 mars 2023</b> | <b>31 mars 2022</b> |
|--|---------------------|---------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier                    | 235 612 477         | 184 765 000         |
| Souscriptions  | 19 834 946          | 62 404 313          |
| Rachats  | (7 674 568)         | (11 556 836)        |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier                    | 247 772 855         | 235 612 477         |

| <b>SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF Couvert en EUR</b> | <b>31 mars 2023</b> | <b>31 mars 2022</b> |
|---|---------------------|---------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier                           | 8 500               | -                   |
| Souscriptions   | 2 645 661           | 8 500               |
| Rachats   | (915 709)           | -                   |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier                           | 1 738 452           | 8 500               |

| <b>SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF Non couvert en USD</b> | <b>31 mars 2023</b> | <b>31 mars 2022</b> |
|---|---------------------|---------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier                               | 3 166 134           | 3 315 137           |
| Souscriptions   | 3 778 129           | 1 632 600           |
| Rachats   | (3 343 068)         | (1 781 603)         |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier                               | 3 601 195           | 3 166 134           |

| <b>SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF Non couvert en USD (Acc)</b> | <b>31 mars 2023</b> | <b>31 mars 2022</b> |
|---|---------------------|---------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier                     | 1 332 781           | 309 320             |
| Souscriptions   | 209 720             | 1 734 447           |
| Rachats   | (243 848)           | (710 986)           |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier                     | 1 298 653           | 1 332 781           |

| <b>SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF Non couvert en USD (Dist)</b> | <b>31 mars 2023</b> | <b>31 mars 2022</b> |
|--|---------------------|---------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier                      | 7 514 826           | 6 667 447           |
| Souscriptions  | 2 371 824           | 2 065 612           |
| Rachats  | (2 564 606)         | (1 218 233)         |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier                      | 7 322 044           | 7 514 826           |



## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 5. CAPITAL SOCIAL (SUITE)

**SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK  
Real Estate UCITS ETF**

|  | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|--|-----------------|-----------------|
|--|-----------------|-----------------|

|   |           |           |
|---|-----------|-----------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 1 793 938 | 1 863 938 |
| Souscriptions   | 300 000   | 30 000    |
| Rachats   | (510 000) | (100 000) |

|   |           |           |
|---|-----------|-----------|
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 1 583 938 | 1 793 938 |
|---|-----------|-----------|

**SPDR FTSE U.K. All Share UCITS  
ETF**

|  | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|--|-----------------|-----------------|
|--|-----------------|-----------------|

**Non couvert en GBP (Acc)**

|   |             |             |
|---|-------------|-------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 9 923 941   | 13 143 923  |
| Souscriptions   | 1 406 116   | 1 552 948   |
| Rachats   | (1 268 195) | (4 772 930) |

|   |            |           |
|---|------------|-----------|
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 10 061 862 | 9 923 941 |
|---|------------|-----------|

**SPDR FTSE U.K. All Share UCITS  
ETF**

|  | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|--|-----------------|-----------------|
|--|-----------------|-----------------|

**Non couvert en GBP (Dist)**

|   |             |              |
|---|-------------|--------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 18 523 269  | 28 322 173   |
| Souscriptions   | 3 637 861   | 7 024 724    |
| Rachats   | (6 268 001) | (16 823 628) |

|   |            |            |
|---|------------|------------|
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 15 893 129 | 18 523 269 |
|---|------------|------------|

**SPDR MSCI ACWI UCITS ETF**

|  | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|--|-----------------|-----------------|
|--|-----------------|-----------------|

**Couvert en EUR**

|   |              |             |
|---|--------------|-------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 25 183 372   | 13 880 325  |
| Souscriptions   | 19 718 207   | 19 071 322  |
| Rachats   | (21 752 647) | (7 768 275) |

|   |            |            |
|---|------------|------------|
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 23 148 932 | 25 183 372 |
|---|------------|------------|

**SPDR MSCI ACWI UCITS ETF**

|  | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|--|-----------------|-----------------|
|--|-----------------|-----------------|

**Couvert en USD**

|   |             |           |
|---|-------------|-----------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 2 359 592   | 2 926 276 |
| Souscriptions   | 1 098 368   | 58 060    |
| Rachats   | (1 063 185) | (624 744) |

|   |           |           |
|---|-----------|-----------|
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 2 394 775 | 2 359 592 |
|---|-----------|-----------|

**SPDR MSCI ACWI UCITS ETF**

|  | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|--|-----------------|-----------------|
|--|-----------------|-----------------|

**Non couvert en USD**

|   |             |             |
|---|-------------|-------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 14 095 467  | 14 364 026  |
| Souscriptions   | 3 303 128   | 3 699 134   |
| Rachats   | (4 848 082) | (3 967 693) |

|   |            |            |
|---|------------|------------|
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 12 550 513 | 14 095 467 |
|---|------------|------------|

**SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF**

|  | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|--|-----------------|-----------------|
|--|-----------------|-----------------|

|   |            |             |
|---|------------|-------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 15 000 000 | 16 520 000  |
| Souscriptions   | 364 000    | 160 000     |
| Rachats   | (260 000)  | (1 680 000) |

|   |            |            |
|---|------------|------------|
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 15 104 000 | 15 000 000 |
|---|------------|------------|

**SPDR MSCI EMU UCITS ETF**

|  | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|--|-----------------|-----------------|
|--|-----------------|-----------------|

|   |           |             |
|---|-----------|-------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 3 870 000 | 5 060 000   |
| Souscriptions   | 150 000   | 770 000     |
| Rachats   | (600 000) | (1 960 000) |

|   |           |           |
|---|-----------|-----------|
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 3 420 000 | 3 870 000 |
|---|-----------|-----------|

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 5. CAPITAL SOCIAL (SUITE)

| <b>SPDR MSCI Japan UCITS ETF<br/>Couvert en EUR</b>     | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|---|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 277 384                 | 100 000                 |
| Souscriptions   | 341 218                 | 807 568                 |
| Rachats   | (245 967)               | (630 184)               |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 372 635                 | 277 384                 |

| <b>SPDR MSCI Japan UCITS ETF<br/>Non couvert en JPY</b> | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|---|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 5 054 709               | 1 800 000               |
| Souscriptions   | 1 330 175               | 4 661 709               |
| Rachats   | (464 437)               | (1 407 000)             |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 5 920 447               | 5 054 709               |

| <b>SPDR MSCI World UCITS ETF</b>                        | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|---|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 46 885 000              | 26 625 000              |
| Souscriptions   | 33 250 000              | 21 020 000              |
| Rachats   | (2 090 000)             | (760 000)               |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 78 045 000              | 46 885 000              |

| <b>SPDR S&amp;P 400 U.S. Mid Cap UCITS<br/>ETF</b>      | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|---|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 16 730 000              | 13 860 000              |
| Souscriptions   | 8 470 000               | 4 340 000               |
| Rachats   | (3 570 000)             | (1 470 000)             |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 21 630 000              | 16 730 000              |

| <b>SPDR S&amp;P 500 ESG Leaders UCITS<br/>ETF*</b>      | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|---|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 19 000 000              | 13 400 000              |
| Souscriptions   | 12 000 000              | 9 200 000               |
| Rachats   | (4 400 000)             | (3 600 000)             |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 26 600 000              | 19 000 000              |

\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

| <b>SPDR S&amp;P 500 UCITS ETF<br/>Couvert en EUR</b>    | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|---|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 34 700 820              | 30 265 398              |
| Souscriptions   | 35 483 584              | 24 731 515              |
| Rachats   | (28 657 334)            | (20 296 093)            |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 41 527 070              | 34 700 820              |

| <b>SPDR S&amp;P 500 UCITS ETF<br/>Non couvert en USD</b> | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|--|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier  | 13 146 599              | 12 987 219              |
| Souscriptions  | 1 675 394               | 1 517 839               |
| Rachats  | (3 032 525)             | (1 358 459)             |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier  | 11 789 468              | 13 146 599              |

| <b>SPDR S&amp;P 500 Low Volatility UCITS<br/>ETF</b>    | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|---|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier | 2 600 000               | 3 400 000               |
| Souscriptions   | 1 700 000               | 1 500 000               |
| Rachats   | (2 000 000)             | (2 300 000)             |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier | 2 300 000               | 2 600 000               |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 5. CAPITAL SOCIAL (SUITE)

| <b>SPDR S&amp;P Emerging Markets<br/>Dividend Aristocrats UCITS ETF</b> | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|---|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier                 | 7 000 000               | 9 400 000               |
| Souscriptions   | 3 600 000               | 300 000                 |
| Rachats   | (900 000)               | (2 700 000)             |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier                 | 9 700 000               | 7 000 000               |

| <b>SPDR S&amp;P Euro Dividend Aristocrats<br/>UCITS ETF</b> | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|---|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier     | 50 800 000              | 66 800 000              |
| Souscriptions   | 14 900 000              | 16 100 000              |
| Rachats   | (9 400 000)             | (32 100 000)            |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier     | 56 300 000              | 50 800 000              |

| <b>SPDR S&amp;P Global Dividend<br/>Aristocrats UCITS ETF</b> | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|---|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier       | 34 300 000              | 21 100 000              |
| Souscriptions   | 16 450 000              | 19 100 000              |
| Rachats   | (11 550 000)            | (5 900 000)             |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier       | 39 200 000              | 34 300 000              |

| <b>SPDR S&amp;P Pan Asia Dividend<br/>Aristocrats UCITS ETF</b> | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|---|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier         | 3 360 000               | 4 200 000               |
| Souscriptions   | 300 000                 | 460 000                 |
| Rachats   | (300 000)               | (1 300 000)             |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier         | 3 360 000               | 3 360 000               |

| <b>SPDR S&amp;P U.K. Dividend Aristocrats<br/>UCITS ETF</b> | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|---|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier     | 11 400 000              | 10 500 000              |
| Souscriptions   | 4 700 000               | 1 700 000               |
| Rachats   | (3 400 000)             | (800 000)               |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier     | 12 700 000              | 11 400 000              |

| <b>SPDR S&amp;P U.S. Dividend Aristocrats<br/>UCITS ETF<br/>Couvert en EUR</b> | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|--|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier                        | 12 739 175              | 3 173 872               |
| Souscriptions  | 22 776 768              | 13 266 159              |
| Rachats  | (10 134 868)            | (3 700 856)             |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier                        | 25 381 075              | 12 739 175              |

| <b>SPDR S&amp;P U.S. Dividend Aristocrats<br/>UCITS ETF<br/>Non couvert en USD</b> | <b>31 mars<br/>2023</b> | <b>31 mars<br/>2022</b> |
|--|-------------------------|-------------------------|
| Actions en circulation au début de l'exercice financier                            | 53 744 318              | 44 930 282              |
| Souscriptions  | 24 251 336              | 18 442 896              |
| Rachats  | (9 346 882)             | (9 628 860)             |
| Actions en circulation à la fin de l'exercice financier                            | 68 648 772              | 53 744 318              |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 6. PARTIES LIÉES

Les parties sont considérées comme des parties liées si l'une d'elles a une capacité de contrôle sur l'autre ou est en mesure d'exercer une influence significative sur l'autre, lors de la prise de décisions financières ou opérationnelles.

#### Entités avec contrôle conjoint

Selon les Administrateurs, la Société de gestion, le Gestionnaire d'investissement, le Distributeur mondial, le Distributeur délégué, les Gestionnaires d'investissement par délégation, l'Agent administratif, l'Agent de transfert et d'enregistrement, les Administrateurs de la Société de gestion et le Dépositaire sont tous des parties liées à la Société. Veuillez vous reporter à la Note 3 intitulée « Commissions et frais » pour une explication sur le barème des commissions de la Société. Toutes les transactions ont été souscrites dans le cadre normal des activités.

#### Administrateurs

Les Administrateurs sont habilités à percevoir des commissions et des indemnités pour débours, lesquelles font partie intégrante des TFE, comme stipulé à la Note 3. Le montant total des commissions des Administrateurs pour l'exercice financier s'est élevé à 128 510 USD (31 mars 2022 : 142 496 USD), dont 11 679 USD (31 mars 2022 : 0 USD) payables à la fin de l'exercice financier.

M<sup>me</sup> Kathleen Gallagher et M<sup>me</sup> Ellen Needham n'ont pas perçu d'honoraires en tant qu'Administratrices pour les exercices financiers clôturés les 31 mars 2023 et 31 mars 2022.

Les intérêts des Administrateurs dans des parties liées sont les suivants :

M. Patrick J. Riley était, jusqu'à sa démission au 16 mars 2023, membre non exécutif du « Board of Trustees » (conseil d'administration fiduciaire) de SSGA Mutual Funds complex aux États-Unis.

Mme Kathleen Gallagher est Directrice générale de State Street Global Advisors, Responsable de l'Australie et Responsable des modèles de portefeuilles ETF dans les régions EMEA et APAC pour l'activité SPDR.

Mme Ellen Needham (jusqu'à sa démission au 1<sup>er</sup> mai 2023) était Directrice générale senior de State Street Global Advisors, Responsable de la gestion des fonds mondiaux et présidente de SSGA Funds Management, Inc.

Les intérêts des Administrateurs de la Société de gestion dans des parties liées sont les suivants :

Ann Prendergast est également Directrice générale senior et Responsable de State Street Global Advisors Europe Limited.

Eric Linnane est également Directeur général et Responsable des opérations d'investissement de State Street Global Advisors Europe Limited.

Ulla Pitha, jusqu'à sa démission le 30 juin 2022, était Responsable de la stratégie de State Street Global Advisors EMEA.

Marie-Anne Heeren (nommée le 7 septembre 2022) est Directrice générale senior et Responsable du groupe de clients institutionnels de SSGA pour l'Europe. Mme Heeren est également Directrice de la succursale belge de State Street Global Advisors Europe Limited.

Au 1<sup>er</sup> août 2021, la Société a nommé State Street Global Advisors Europe Limited (la « Société de gestion ») aux fins d'assurer la gestion quotidienne de ses activités et ce, sous la supervision générale du Conseil d'administration. La Société de gestion est chargée de l'investissement des actifs de la Société et a remplacé State Street Global Advisors Limited en qualité de Gestionnaire d'investissement principal. State Street Global Advisors Limited, State Street Global Advisors Trust Company et State Street Global Advisors Singapore Limited sont les Gestionnaires d'investissement par délégation pour la Société à la suite de cette nomination. En outre, SSGA Europe a établi une succursale polonaise par l'intermédiaire de laquelle elle peut également fournir ces services.

La Société de gestion est également chargée de l'administration de la Société, ainsi que de la mise en œuvre de la politique de distribution et de commercialisation de la Société et des Compartiments.

#### Transactions avec des parties liées

Au 31 mars 2023, les Compartiments ci-dessous détenaient des actions dans State Street Corporation, la société mère de la Société de gestion :

| Compartiment                        | Actions | Juste valeur |
|-------------------------------------|---------|--------------|
| SPDR MSCI ACWI UCITS ETF            | 16 977  | 1 284 989    |
| SPDR MSCI World UCITS ETF           | 14 784  | 1 119 001    |
| SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF* | 15 682  | 1 186 971    |
| SPDR S&P 500 UCITS ETF              | 55 847  | 4 227 059    |

\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

Au 31 mars 2022, les Compartiments ci-dessous détenaient des actions de State Street Corporation.

| Compartiment                         | Actions | Juste valeur |
|--------------------------------------|---------|--------------|
| SPDR MSCI ACWI UCITS ETF             | 19 150  | 1 668 348    |
| SPDR MSCI World UCITS ETF            | 8 716   | 759 338      |
| SPDR S&P 500 ESG Screened UCITS ETF* | 5 671   | 494 058      |
| SPDR S&P 500 UCITS ETF               | 61 081  | 5 321 377    |

\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 6. PARTIES LIÉES (SUITE)

Les achats et ventes d'actions de State Street Corporation et les plus-values/(moins-values) réalisées au cours de l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 sont indiqués ci-dessous :

| Compartiment                        | Achats  | Ventes    | Plus-values/<br>(Moins-values)<br>réalisées |
|-------------------------------------|---------|-----------|---|
| SPDR MSCI ACWI UCITS ETF            | 252 012 | 390 717   | (19 245)                                    |
| SPDR MSCI World UCITS ETF           | 461 983 | 29 884    | (1 048)                                     |
| SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF* | 940 346 | 270 023   | 31 557                                      |
| SPDR S&P 500 UCITS ETF              | 676 302 | 1 037 526 | (68 780)                                    |

\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

Les achats et ventes d'actions de State Street Corporation et les plus/(moins)-values réalisées au cours de l'exercice financier clôturé le 31 mars 2022 sont indiqués ci-dessous :

| Compartiment                        | Achats    | Ventes  | Plus-values/<br>(Moins-values)<br>réalisées |
|-------------------------------------|-----------|---------|---|
| SPDR MSCI ACWI UCITS ETF            | 403 358   | 309 927 | 54 082                                      |
| SPDR MSCI World UCITS ETF           | 361 868   | 13 133  | 1 562                                       |
| SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF* | 251 277   | 92 946  | 17 574                                      |
| SPDR S&P 500 UCITS ETF              | 1 098 900 | 913 864 | 113 508                                     |

\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17

### 7. DISTRIBUTIONS

Les tableaux des distributions sont présentés dans la devise de référence du Compartiment ou de la catégorie d'actions indiquée.

Les Compartiments suivants effectuent des distributions semestrielles au cours ou aux alentours des mois de janvier et juillet et ont procédé aux distributions détaillées ci-dessous durant l'exercice financier clôturé le vendredi 31 mars 2023 :

| Compartiment   | Février<br>2023 | Août<br>2022   | Total          |
|--|-----------------|----------------|----------------|
| SPDR Bloomberg 0-3<br>Year Euro Corporate<br>Bond UCITS ETF              | 7 242 799 EUR   | 2 138 992 EUR  | 9 381 791 EUR  |
| SPDR Bloomberg 0-3<br>Year U.S. Corporate<br>Bond UCITS ETF              | 2 790 649 USD   | 898 414 USD    | 3 689 063 USD  |
| SPDR Bloomberg 1-3<br>Year U.S. Treasury<br>Bond UCITS ETF               | 1 331 949 USD   | 628 562 USD    | 1 960 511 USD  |
| SPDR Bloomberg 1-10<br>Year U.S. Corporate<br>Bond UCITS ETF             | 2 613 314 USD   | 1 170 378 USD  | 3 783 692 USD  |
| SPDR Bloomberg<br>Emerging Markets<br>Local Bond UCITS                   | 45 559 898 USD  | 43 990 327 USD | 89 550 225 USD |
| SPDR Bloomberg<br>Euro Aggregate Bond<br>UCITS ETF                       | 1 847 274 EUR   | 963 427 EUR    | 2 810 701 EUR  |
| SPDR Bloomberg<br>Euro Government<br>Bond UCITS ETF                      | 943 877 EUR     | 461 594 EUR    | 1 405 471 EUR  |
| SPDR Bloomberg<br>Euro High Yield Bond<br>UCITS ETF                      | 9 499 018 EUR   | 8 425 175 EUR  | 17 924 193 EUR |
| SPDR Bloomberg<br>Global Aggregate<br>Bond UCITS ETF -<br>Couvert en EUR | 3 746 382 EUR   | 2 353 182 EUR  | 6 099 564 EUR  |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 7. DISTRIBUTIONS (SUITE)

| Compartiment   | Février<br>2023 | Août<br>2022   | Total          |
|--|-----------------|----------------|----------------|
| SPDR Bloomberg<br>Global Aggregate<br>Bond UCITS ETF -<br>Couvert en GBP     | 247 550 GBP     | 182 485 GBP    | 430 035 GBP    |
| SPDR Bloomberg<br>Global Aggregate<br>Bond UCITS ETF -<br>Couvert en USD     | 7 848 182 USD   | 6 286 525 USD  | 14 134 707 USD |
| SPDR Bloomberg<br>Global Aggregate<br>Bond UCITS ETF -<br>Non couvert en USD | 3 105 864 USD   | 2 805 735 USD  | 5 911 599 USD  |
| SPDR Bloomberg<br>U.S. Treasury Bond<br>UCITS ETF                            | 5 076 856 USD   | 3 949 938 USD  | 9 026 794 USD  |
| SPDR Bloomberg U.S.<br>TIPS UCITS ETF  | 8 043 789 USD   | 16 439 171 USD | 24 482 960 USD |
| SPDR Bloomberg<br>SASB U.S. High Yield<br>Corporate ESG UCITS<br>ETF         | 4 996 437 USD   | 4 406 949 USD  | 9 403 386 USD  |
| SPDR S&P Emerging<br>Markets Dividend<br>Aristocrats UCITS ETF               | 2 903 120 USD   | 2 581 810 USD  | 5 484 930 USD  |
| SPDR S&P Pan Asia<br>Dividend Aristocrats<br>UCITS ETF                       | 1 813 680 USD   | 2 948 040 USD  | 4 761 720 USD  |

Les Compartiments suivants effectuent des distributions semestrielles au cours ou aux alentours des mois de mars et septembre et ont procédé aux distributions détaillées ci-dessous durant l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 :

| Compartiment                                       | Mars<br>2023  | Septembre<br>2022 | Total          |
|--|---------------|-------------------|----------------|
| SPDR FTSE U.K. All<br>Share UCITS ETF              | 936 633 GBP   | 1 960 396 GBP     | 2 897 029 GBP  |
| SPDR S&P Euro<br>Dividend Aristocrats<br>UCITS ETF | 4 747 600 EUR | 34 354 740 EUR    | 39 102 340 EUR |
| SPDR S&P U.K.<br>Dividend Aristocrats<br>UCITS ETF | 1 783 080 GBP | 4 543 200 GBP     | 6 326 280 GBP  |

Les Compartiments suivants effectuent des distributions trimestrielles au cours ou aux alentours des mois de mars, juin, septembre et décembre et ont procédé aux distributions détaillées ci-dessous durant l'exercice clôturé le 31 mars 2023 :

| Compartiment   | Mars<br>2023      | Décembre<br>2022 | Total           |
|--|-------------------|------------------|-----------------|
| SPDR Dow Jones Global Real Estate<br>UCITS ETF                             | 1 446 058 USD     | 1 224 237 USD    |                 |
| SPDR S&P 500 UCITS ETF   | 15 709 767 USD    | 16 518 567 USD   |                 |
| SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats<br>UCITS ETF - Couvert en EUR           | 1 107 376 EUR     | 1 159 477 EUR    |                 |
| SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats<br>UCITS ETF - Non couvert en USD       | 27 257 999 USD    | 26 785 087 USD   |                 |
| Compartiment   | Septembre<br>2022 | Juin<br>2022     | Total           |
| SPDR Dow Jones<br>Global Real Estate<br>UCITS ETF                          | 1 688 786 USD     | 1 825 783 USD    | 6 184 864 USD   |
| SPDR S&P 500<br>UCITS ETF  | 17 516 730 USD    | 18 042 838 USD   | 67 787 902 USD  |
| SPDR S&P<br>U.S. Dividend<br>Aristocrats UCITS<br>ETF - Couvert en<br>EUR  | 797 253 EUR       | 686 477 EUR      | 3 750 583 EUR   |
| SPDR S&P U.S.<br>Dividend Aristocrats<br>UCITS ETF - Non<br>couvert en USD | 24 353 730 USD    | 22 417 734 USD   | 100 814 550 USD |

Le Compartiment SPDR Global Dividend Aristocrats UCITS ETF peut effectuer des distributions trimestrielles au cours ou aux alentours des mois de janvier, avril, juillet et octobre et a procédé aux distributions détaillées ci-dessous durant l'exercice clôturé le 31 mars 2023 :

| Compartiment   | Février<br>2023 | Novembre<br>2022 | Total          |
|--|-----------------|------------------|----------------|
| SPDR S&P Global Dividend Aristocrats<br>UCITS ETF    | 10 632 000 USD  | 10 604 825 USD   |                |
| Compartiment   | Août<br>2022    | Mai<br>2022      | Total          |
| SPDR S&P Global<br>Dividend Aristocrats<br>UCITS ETF | 23 533 500 USD  | 10 225 350 USD   | 54 995 675 USD |

Le montant des distributions de la Société pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 a totalisé 541 146 666 USD (31 mars 2022 : 485 730 195 USD).

Le Compartiment SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF n'a pas pu distribuer de revenu d'exploitation.

Les Compartiments restants de la Société n'ont pas effectué de distribution au cours de l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023.

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 7. DISTRIBUTIONS (SUITE)

Les Compartiments suivants effectuent des distributions semestrielles au cours ou aux alentours des mois de janvier et juillet et ont procédé aux distributions détaillées ci-dessous durant l'exercice financier clôturé le jeudi 31 mars 2022 :

| Compartiment  | Février<br>2022 | Août<br>2021   | Total           |
|---|-----------------|----------------|-----------------|
| SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF           | 1 043 710 EUR   | 2 291 221 EUR  | 3 334 931 EUR   |
| SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF           | 712 503 USD     | 936 187 USD    | 1 648 690 USD   |
| SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF            | 155 090 USD     | 259 937 USD    | 415 027 USD     |
| SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF          | 762 707 USD     | 913 523 USD    | 1 676 230 USD   |
| SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF            | 51 933 916 USD  | 57 829 368 USD | 109 763 284 USD |
| SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF                    | 1 118 907 EUR   | 1 187 641 EUR  | 2 306 548 EUR   |
| SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF                   | 288 556 EUR     | 239 139 EUR    | 527 695 EUR     |
| SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF                   | 10 413 396 EUR  | 13 340 652 EUR | 23 754 048 EUR  |
| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF - Couvert en EUR | 1 367 120 EUR   | 1 178 548 EUR  | 2 545 668 EUR   |
| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF - Couvert en GBP | 167 320 GBP     | 360 849 GBP    | 528 169 GBP     |
| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF - Couvert en USD | 5 917 444 USD   | 5 931 702 USD  | 11 849 146 USD  |

| Compartiment  | Février<br>2022 | Août<br>2021   | Total          |
|---|-----------------|----------------|----------------|
| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF - Non couvert en USD | 2 930 572 USD   | 2 729 397 USD  | 5 659 969 USD  |
| SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF                                  | 11 195 865 USD  | 11 442 687 USD | 22 638 552 USD |
| SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF                         | 2 149 870 USD   | 2 143 901 USD  | 4 293 771 USD  |
| SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF         | 3 939 852 USD   | 4 572 381 USD  | 8 512 233 USD  |
| SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF            | 1 919 550 USD   | 2 777 640 USD  | 4 697 190 USD  |
| SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF                    | 1 987 980 USD   | 3 826 620 USD  | 5 814 600 USD  |

Les Compartiments suivants effectuent des distributions semestrielles au cours ou aux alentours des mois de mars et septembre et ont procédé aux distributions détaillées ci-dessous durant l'exercice financier clôturé le 31 mars 2022 :

| Compartiment                                 | Mars<br>2022  | Octobre<br>2021 | Total          |
|--|---------------|-----------------|----------------|
| SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF           | 907 919 GBP   | 1 871 468 GBP   | 2 779 387 GBP  |
| SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF | 3 268 580 EUR | 40 393 420 EUR  | 43 662 000 EUR |
| SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF | 1 550 920 GBP | 3 522 300 GBP   | 5 073 220 GBP  |

Les Compartiments suivants effectuent des distributions trimestrielles au cours ou aux alentours des mois de mars, juin, septembre et décembre et ont procédé aux distributions détaillées ci-dessous durant l'exercice clôturé le 31 mars 2022 :

| Compartiment  | Mars<br>2022   | Décembre<br>2021 |
|---|----------------|------------------|
| SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF                       | 1 340 997 USD  | 1 269 669 USD    |
| SPDR S&P 500 UCITS ETF  | 16 071 647 USD | 15 523 882 USD   |
| SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF - Couvert en EUR     | 565 816 EUR    | 118 688 EUR      |
| SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF - Non couvert en USD | 19 292 467 USD | 21 108 594 USD   |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 7. DISTRIBUTIONS (SUITE)

| Compartiment                                       | Septembre<br>2021 | Juin<br>2021   | Total          |
|--|-------------------|----------------|----------------|
| SPDR Dow Jones<br>Global Real Estate<br>UCITS ETF  | 1 418 263 USD     | 1 838 641 USD  | 5 867 570 USD  |
| SPDR S&P 500 UCITS<br>ETF                          | 14 876 825 USD    | 15 765 801 USD | 62 238 155 USD |
| SPDR S&P<br>U.S. Dividend<br>Aristocrats UCITS ETF |                   |                |                |
| - Couvert en EUR                                   | 118 825 EUR       | 175 901 EUR    | 979 230 EUR    |
| SPDR S&P U.S.<br>Dividend Aristocrats<br>UCITS ETF |                   |                |                |
| Non couvert en USD                                 | 17 514 340 USD    | 16 671 618 USD | 74 587 019 USD |

Le Compartiment SPDR Global Dividends Aristocrats UCITS ETF peut effectuer des distributions trimestrielles au cours ou aux alentours des mois de janvier, avril, juillet et octobre et a procédé aux distributions détaillées ci-dessous durant l'exercice clôturé le 31 mars 2022 :

| Compartiment                                      | Février<br>2022 | Novembre<br>2021 |
|---|-----------------|------------------|
| SPDR S&P Global Dividend Aristocrats<br>UCITS ETF | 9 177 920 USD   | 7 097 160 USD    |

| Compartiment   | Août<br>2021  | Mai<br>2021   | Total          |
|--|---------------|---------------|----------------|
| SPDR S&P Global<br>Dividend Aristocrats<br>UCITS ETF | 9 840 030 USD | 7 209 520 USD | 33 324 630 USD |

Les Compartiments restants de la Société n'ont pas effectué de distribution au cours de l'exercice financier clôturé le 31 mars 2022

### 8. ACCORDS DE COMMISSIONS INDIRECTES ET COURTAGE DIRIGÉ

Ni la Société ni le Gestionnaire d'investissement ou le Gestionnaire d'investissement par délégation n'ont souscrit de contrats de commissions indirectes ou de services de courtage dirigé eu égard à la Société durant l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (31 mars 2022 : néant).

### 9. VARIATIONS NETTES DE LA JUSTE VALEUR DES ACTIFS ET PASSIFS FINANCIERS À LA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT

Exercices clôturés le 31 mars 2023 et le 31 mars 2022

Plus-values/(Moins-values) nettes sur activités d'investissement

| SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro<br>Corporate Bond UCITS ETF   | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|--|-----------------|-----------------|
|  | EUR             | EUR             |
| Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :  |                 |                 |
| Investissements  | (22 546 882)    | 1 313 844       |
| Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :  |                 |                 |
| Investissements  | (25 243 587)    | (26 766 897)    |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat | (47 790 469)    | (25 453 053)    |

| SPDR Bloomberg 0-3 Year<br>U.S. Corporate Bond UCITS ETF   | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|--|-----------------|-----------------|
|  | USD             | USD             |
| Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :  |                 |                 |
| Investissements  | (1 599 030)     | (380 014)       |
| Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :  |                 |                 |
| Investissements  | (41 173)        | (3 695 760)     |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat | (1 640 203)     | (4 075 774)     |

| SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill<br>UCITS ETF   | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|--|-----------------|-----------------|
|  | USD             | USD             |
| Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :  |                 |                 |
| Investissements  | (72 852)        | 1 246           |
| Conversions de change  | 2 018 921       | 830 771         |
| Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :  |                 |                 |
| Investissements  | 47 285          | (3 192)         |
| Conversions de change  | (80 457)        | 184 889         |
| Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat | 1 912 897       | 1 013 714       |



## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 9. VARIATIONS NETTES DE LA JUSTE VALEUR DES ACTIFS ET PASSIFS FINANCIERS À LA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT (SUITE)

Exercices clôturés le 31 mars 2023 et le 31 mars 2022  
(suite)

Plus-values/(Moins-values) nettes sur activités d'investissement (suite)

| SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF  | 31 mars 2023        | 31 mars 2022        |
|---|---------------------|---------------------|
|   | EUR                 | EUR                 |
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b>  |                     |                     |
| Investissements   | (15 205 147)        | 1 048 659           |
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b>  |                     |                     |
| Investissements   | (8 615 729)         | (8 499 191)         |
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> | <b>(23 820 876)</b> | <b>(7 450 532)</b>  |
| <b>SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF</b>   | <b>31 mars 2023</b> | <b>31 mars 2022</b> |
|   | USD                 | USD                 |
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b>  |                     |                     |
| Investissements   | (5 653 797)         | (1 069 094)         |
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b>  |                     |                     |
| Investissements   | 3 077 358           | (4 225 714)         |
| Conversions de change   | 11                  | -                   |
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> | <b>(2 576 428)</b>  | <b>(5 294 808)</b>  |
| <b>SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF</b>   | <b>31 mars 2023</b> | <b>31 mars 2022</b> |
|   | USD                 | USD                 |
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b>  |                     |                     |
| Investissements   | (3 105 324)         | (21 817)            |
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b>  |                     |                     |
| Investissements   | (74 969)            | (4 576 482)         |
| Conversions de change   | 1                   | -                   |
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> | <b>(3 180 292)</b>  | <b>(4 598 299)</b>  |

| SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF  | 31 mars 2023         | 31 mars 2022         |
|---|----------------------|----------------------|
|   | USD                  | USD                  |
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b>  |                      |                      |
| Investissements   | (235 878 655)        | (262 603 421)        |
| Conversions de change   | (32 021 051)         | (31 301 472)         |
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b>  |                      |                      |
| Investissements   | 18 969 369           | (69 482 301)         |
| Conversions de change   | 9 673 988            | 5 480 961            |
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> | <b>(239 256 349)</b> | <b>(357 906 233)</b> |
| <b>SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF</b>   | <b>31 mars 2023</b>  | <b>31 mars 2022</b>  |
|   | EUR                  | EUR                  |
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b>  |                      |                      |
| Investissements   | (19 843 883)         | (3 855 969)          |
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b>  |                      |                      |
| Investissements   | (40 248 115)         | (43 279 056)         |
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> | <b>(60 091 998)</b>  | <b>(47 135 025)</b>  |
| <b>SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF</b>  | <b>31 mars 2023</b>  | <b>31 mars 2022</b>  |
|   | EUR                  | EUR                  |
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b>  |                      |                      |
| Investissements   | (28 461 799)         | (2 289 167)          |
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b>  |                      |                      |
| Investissements   | (109 951 343)        | (76 156 717)         |
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> | <b>(138 413 142)</b> | <b>(78 445 884)</b>  |
| <b>SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF</b>  | <b>31 mars 2023</b>  | <b>31 mars 2022</b>  |
|   | EUR                  | EUR                  |
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b>  |                      |                      |
| Investissements   | (49 362 031)         | 4 205 159            |
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b>  |                      |                      |
| Investissements   | 6 025 915            | (42 857 130)         |
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> | <b>(43 336 116)</b>  | <b>(38 651 971)</b>  |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 9. VARIATIONS NETTES DE LA JUSTE VALEUR DES ACTIFS ET PASSIFS FINANCIERS À LA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT (SUITE)

Exercices clôturés le 31 mars 2023 et le 31 mars 2022  
(suite)

Plus-values/(Moins-values) nettes sur activités d'investissement (suite)

| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|--|--------------|--------------|
|  | USD          | USD          |

|  |              |             |
|--|--------------|-------------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |              |             |
| Investissements  | (46 853 216) | (8 000 346) |
| Conversions de change                                    | 51 181 885   | 23 705 705  |
| Titres TBA   | (2 589 060)  | (888 451)   |

|  |               |               |
|--|---------------|---------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |               |               |
| Investissements  | (138 702 895) | (142 469 713) |
| Conversions de change  | (688 734)     | (2 060 386)   |
| Titres TBA   | 763 443       | (146 736)     |

|   |                      |                      |
|---|----------------------|----------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> |                      |                      |
|   | <b>(136 888 577)</b> | <b>(129 859 927)</b> |

| SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|------------------------------------|--------------|--------------|
|                                    | USD          | USD          |

|  |              |            |
|--|--------------|------------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |              |            |
| Investissements  | (16 632 647) | 16 361 209 |

|  |              |              |
|--|--------------|--------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |              |              |
| Investissements  | (34 016 804) | (22 677 481) |
| Conversions de change  | 49           | -            |

|   |                     |                    |
|---|---------------------|--------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> |                     |                    |
|   | <b>(50 649 402)</b> | <b>(6 316 272)</b> |

| SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|---|--------------|--------------|
|   | USD          | USD          |

|  |              |           |
|--|--------------|-----------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |              |           |
| Investissements  | (25 361 298) | (982 753) |

|  |              |              |
|--|--------------|--------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |              |              |
| Investissements  | (12 487 875) | (20 951 120) |
| Contrats à terme standardisés                                    | -            | (114)        |
| Conversions de change  | -            | (6)          |

|   |                     |                     |
|---|---------------------|---------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> |                     |                     |
|   | <b>(37 849 173)</b> | <b>(21 933 993)</b> |

| SPDR Bloomberg China. Treasury Bond UCITS ETF | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|---|--------------|--------------|
|   | USD          | USD          |

|  |           |         |
|--|-----------|---------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |           |         |
| Investissements  | (613 333) | 10 299  |
| Conversions de change                                    | (33 266)  | (4 726) |

|  |             |        |
|--|-------------|--------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |             |        |
| Investissements  | (1 053 703) | 60 818 |
| Conversions de change  | (3 490)     | 599    |

|   |                    |               |
|---|--------------------|---------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> |                    |               |
|   | <b>(1 703 792)</b> | <b>66 990</b> |

\* Le Compartiment a été lancé le 10 novembre 2021.

| SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|--|--------------|--------------|
|  | EUR          | EUR          |

|  |             |             |
|--|-------------|-------------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |             |             |
| Investissements  | (3 522 265) | (1 620 873) |

|  |             |             |
|--|-------------|-------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |             |             |
| Investissements  | (2 329 138) | (3 551 157) |

|   |                    |                    |
|---|--------------------|--------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> |                    |                    |
|   | <b>(5 851 403)</b> | <b>(5 172 030)</b> |

| SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|--|--------------|--------------|
|  | USD          | USD          |

|  |               |              |
|--|---------------|--------------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |               |              |
| Investissements  | (185 937 108) | (17 406 288) |
| Conversions de change                                    | (22 813 590)  | (5 873 596)  |

|  |               |               |
|--|---------------|---------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |               |               |
| Investissements  | (415 783 212) | (402 830 747) |
| Conversions de change  | 8 612 081     | (975 484)     |

|   |                      |                      |
|---|----------------------|----------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> |                      |                      |
|   | <b>(615 921 829)</b> | <b>(427 086 115)</b> |

| SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|---|--------------|--------------|
|   | USD          | USD          |

|  |             |           |
|--|-------------|-----------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |             |           |
| Investissements  | (9 656 160) | 1 951 922 |
| Conversions de change                                    | 266 090     | -         |

|  |             |              |
|--|-------------|--------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |             |              |
| Investissements  | (2 785 298) | (11 276 394) |
| Conversions de change  | 1 386 385   | 3 055        |

|   |                     |                    |
|---|---------------------|--------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> |                     |                    |
|   | <b>(10 788 983)</b> | <b>(9 321 417)</b> |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 9. VARIATIONS NETTES DE LA JUSTE VALEUR DES ACTIFS ET PASSIFS FINANCIERS À LA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT (SUITE)

Exercices clôturés le 31 mars 2023 et le 31 mars 2022  
(suite)

Plus-values/(Moins-values) nettes sur activités d'investissement (suite)

| SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|---|--------------|--------------|
|   | USD          | USD          |

|  |             |            |
|--|-------------|------------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |             |            |
| Investissements  | (7 724 483) | 10 845 706 |
| Contrats à terme standardisés                            | (139 142)   | 152 489    |
| Conversions de change                                    | (74 861)    | (56 274)   |

|  |              |            |
|--|--------------|------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |              |            |
| Investissements  | (68 323 643) | 28 223 074 |
| Contrats à terme standardisés                                    | (134 257)    | 150 210    |
| Conversions de change  | 8 930        | 1 659      |

|   |                     |                   |
|---|---------------------|-------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> |                     |                   |
|   | <b>(76 387 456)</b> | <b>39 316 864</b> |

| SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|---|--------------|--------------|
|   | EUR          | EUR          |

|  |             |           |
|--|-------------|-----------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |             |           |
| Investissements  | (5 848 580) | 2 416 079 |
| Conversions de change                                    | (2 107)     | (8 818)   |

|  |              |           |
|--|--------------|-----------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |              |           |
| Investissements  | (17 459 523) | 1 551 379 |
| Conversions de change  | (396)        | 302       |

|   |                     |                  |
|---|---------------------|------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> |                     |                  |
|   | <b>(23 310 606)</b> | <b>3 958 942</b> |

| SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|------------------------------------|--------------|--------------|
|                                    | GBP          | GBP          |

|  |           |            |
|--|-----------|------------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |           |            |
| Investissements  | 2 599 393 | 12 504 079 |
| Contrats à terme standardisés                            | 36 466    | 521 396    |
| Conversions de change                                    | 72 509    | 15 439     |

|  |             |            |
|--|-------------|------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |             |            |
| Investissements  | (9 948 805) | 54 972 967 |
| Contrats à terme standardisés                                    | (500 812)   | 601 653    |
| Conversions de change  | (66 538)    | (10 084)   |

|   |                    |                   |
|---|--------------------|-------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> |                    |                   |
|   | <b>(7 807 787)</b> | <b>68 605 450</b> |

| SPDR MSCI ACWI UCITS ETF | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|--------------------------|--------------|--------------|
|                          | USD          | USD          |

|  |              |              |
|--|--------------|--------------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |              |              |
| Investissements  | 53 574 630   | 130 370 576  |
| Contrats à terme standardisés                            | (441 344)    | (1 006 914)  |
| Conversions de change                                    | (23 017 923) | (16 242 956) |

|  |               |            |
|--|---------------|------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |               |            |
| Investissements  | (359 163 603) | 21 982 817 |
| Contrats à terme standardisés                                    | (409 208)     | 772 201    |
| Conversions de change  | 6 701 470     | 2 479 286  |

|   |                      |                    |
|---|----------------------|--------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> |                      |                    |
|   | <b>(322 755 978)</b> | <b>138 355 010</b> |

| SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|-----------------------------|--------------|--------------|
|                             | USD          | USD          |

|  |              |            |
|--|--------------|------------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |              |            |
| Investissements  | (27 826 593) | 39 751 988 |
| Contrats à terme standardisés                            | 571 291      | (87 750)   |
| Conversions de change                                    | (321 408)    | (208 690)  |

|  |              |               |
|--|--------------|---------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |              |               |
| Investissements  | (97 036 839) | (271 094 743) |
| Contrats à terme standardisés                                    | (85 184)     | 78 735        |
| Conversions de change  | 7 351        | 37 951        |

|   |                      |                      |
|---|----------------------|----------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> |                      |                      |
|   | <b>(124 691 382)</b> | <b>(231 522 509)</b> |

| SPDR MSCI EMU UCITS ETF | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|-------------------------|--------------|--------------|
|                         | EUR          | EUR          |

|  |           |            |
|--|-----------|------------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |           |            |
| Investissements  | 4 144 163 | 24 637 834 |
| Contrats à terme standardisés                            | 115 548   | (42 845)   |
| Conversions de change                                    | (1 002)   | 931        |

|  |           |              |
|--|-----------|--------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |           |              |
| Investissements  | 8 300 914 | (20 912 571) |
| Contrats à terme standardisés                                    | (8 698)   | 12 767       |
| Conversions de change  | (1 098)   | (788)        |

|   |                   |                  |
|---|-------------------|------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> |                   |                  |
|   | <b>12 549 827</b> | <b>3 695 328</b> |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 9. VARIATIONS NETTES DE LA JUSTE VALEUR DES ACTIFS ET PASSIFS FINANCIERS À LA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT (SUITE)

Exercices clôturés le 31 mars 2023 et le 31 mars 2022  
(suite)

Plus-values/(Moins-values) nettes sur activités d'investissement (suite)

|  | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|--|-----------------|-----------------|
|  | JPY             | JPY             |

|  |               |              |
|--|---------------|--------------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |               |              |
| Investissements  | (186 295 460) | 253 514 823  |
| Contrats à terme standardisés                            | 33 003 580    | (23 473 513) |
| Conversions de change                                    | 238 741 986   | (45 715 790) |

|  |              |               |
|--|--------------|---------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |              |               |
| Investissements  | 861 245 880  | (437 737 928) |
| Contrats à terme standardisés                                    | (11 605 548) | 14 656 370    |
| Conversions de change  | (66 697 595) | 78 209 015    |

|   |                    |                      |
|---|--------------------|----------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> | <b>868 392 843</b> | <b>(160 547 023)</b> |
|---|--------------------|----------------------|

|  | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|--|-----------------|-----------------|
|  | USD             | USD             |

|  |             |           |
|--|-------------|-----------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |             |           |
| Investissements  | (8 406 528) | 4 214 565 |
| Contrats à terme standardisés                            | 199 264     | 395 573   |
| Conversions de change                                    | (233 299)   | (156 661) |

|  |              |            |
|--|--------------|------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |              |            |
| Investissements  | (62 472 703) | 57 289 449 |
| Contrats à terme standardisés                                    | (69 776)     | 307 027    |
| Conversions de change  | (7 937)      | 35 225     |

|   |                     |                   |
|---|---------------------|-------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> | <b>(70 990 979)</b> | <b>62 085 178</b> |
|---|---------------------|-------------------|

|  | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|--|-----------------|-----------------|
|  | USD             | USD             |

|  |            |            |
|--|------------|------------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |            |            |
| Investissements  | 25 521 382 | 80 979 475 |
| Contrats à terme standardisés                            | (49 963)   | (17 539)   |

|  |               |              |
|--|---------------|--------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |               |              |
| Investissements  | (137 625 911) | (51 915 255) |
| Contrats à terme standardisés                                    | (30 066)      | 60 450       |
| Conversions de change  | 7             | -            |

|   |                      |                   |
|---|----------------------|-------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> | <b>(112 184 551)</b> | <b>29 107 131</b> |
|---|----------------------|-------------------|

|  | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|--|-----------------|-----------------|
|  | USD             | USD             |

|  |           |            |
|--|-----------|------------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |           |            |
| Investissements  | 3 144 288 | 20 069 820 |
| Contrats à terme standardisés                            | (119 960) | 50 313     |

|  |              |            |
|--|--------------|------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |              |            |
| Investissements  | (31 651 871) | 35 933 865 |
| Contrats à terme standardisés                                    | 9 963        | 79 958     |
| Conversions de change  | 31           | -          |

|   |                     |                   |
|---|---------------------|-------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> | <b>(28 617 549)</b> | <b>56 133 956</b> |
|---|---------------------|-------------------|

\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

|  | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|--|-----------------|-----------------|
|  | USD             | USD             |

|  |              |              |
|--|--------------|--------------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |              |              |
| Investissements  | 303 529 969  | 274 807 940  |
| Contrats à terme standardisés                            | (3 077 199)  | 272 777      |
| Conversions de change                                    | (33 331 499) | (35 794 489) |

|  |               |             |
|--|---------------|-------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |               |             |
| Investissements  | (938 219 519) | 506 476 734 |
| Contrats à terme standardisés                                    | 729 172       | 337 448     |
| Conversions de change  | 14 491 597    | 6 459 299   |

|   |                      |                    |
|---|----------------------|--------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> | <b>(655 877 479)</b> | <b>752 559 709</b> |
|---|----------------------|--------------------|

|  | 31 mars<br>2023 | 31 mars<br>2022 |
|--|-----------------|-----------------|
|  | USD             | USD             |

|  |           |            |
|--|-----------|------------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |           |            |
| Investissements  | 1 562 329 | 36 739 028 |
| Contrats à terme standardisés                            | (3 234)   | 63 885     |

|  |              |             |
|--|--------------|-------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |              |             |
| Investissements  | (13 737 412) | (9 310 476) |
| Contrats à terme standardisés                                    | (4 719)      | 7 676       |
| Conversions de change  | 43           | -           |

|   |                     |                   |
|---|---------------------|-------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> | <b>(12 182 993)</b> | <b>27 500 113</b> |
|---|---------------------|-------------------|

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 9. VARIATIONS NETTES DE LA JUSTE VALEUR DES ACTIFS ET PASSIFS FINANCIERS À LA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT (SUITE)

Exercices clôturés le 31 mars 2023 et le 31 mars 2022  
(suite)

Plus-values/(Moins-values) nettes sur activités d'investissement (suite)

| SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|--|--------------|--------------|
|  | USD          | USD          |

|  |             |             |
|--|-------------|-------------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |             |             |
| Investissements  | (8 276 788) | (6 745 284) |
| Contrats à terme standardisés                            | (155 247)   | (187 696)   |
| Conversions de change                                    | 30 536      | (101 571)   |

|  |             |             |
|--|-------------|-------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |             |             |
| Investissements  | (2 944 370) | (3 532 224) |
| Contrats à terme standardisés                                    | (2 555)     | 72 416      |
| Conversions de change  | (19 816)    | 31 161      |

|   |                     |                     |
|---|---------------------|---------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> |                     |                     |
|   | <b>(11 368 240)</b> | <b>(10 463 198)</b> |

| SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|--|--------------|--------------|
|  | EUR          | EUR          |

|  |              |            |
|--|--------------|------------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |              |            |
| Investissements  | (49 503 787) | 92 063 109 |
| Contrats à terme standardisés                            | 666 503      | 541 822    |
| Conversions de change                                    | (37)         | -          |

|  |            |               |
|--|------------|---------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |            |               |
| Investissements  | 52 630 214 | (142 662 275) |
| Contrats à terme standardisés                                    | 302 937    | 126 295       |
| Conversions de change  | (20 419)   | (13 223)      |

|   |                  |                     |
|---|------------------|---------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> |                  |                     |
|   | <b>4 075 411</b> | <b>(49 944 272)</b> |

| SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|--|--------------|--------------|
|  | USD          | USD          |

|  |              |            |
|--|--------------|------------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |              |            |
| Investissements  | (54 581 813) | 45 520 216 |
| Contrats à terme standardisés                            | 162 909      | 177 199    |
| Conversions de change                                    | (559 204)    | (59 023)   |

|  |               |              |
|--|---------------|--------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |               |              |
| Investissements  | (141 588 426) | (21 388 415) |
| Contrats à terme standardisés                                    | (210 299)     | 397 092      |
| Conversions de change  | 33 606        | (16 756)     |

|   |                      |                   |
|---|----------------------|-------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> |                      |                   |
|   | <b>(196 743 227)</b> | <b>24 630 313</b> |

| SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|--|--------------|--------------|
|  | USD          | USD          |

|  |              |           |
|--|--------------|-----------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |              |           |
| Investissements  | (17 547 988) | 3 644 919 |
| Contrats à terme standardisés                            | 22 812       | (174 577) |
| Conversions de change                                    | (139 396)    | (107 112) |

|  |             |              |
|--|-------------|--------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |             |              |
| Investissements  | (4 196 611) | (19 279 014) |
| Contrats à terme standardisés                                    | (14 854)    | 10 847       |
| Conversions de change  | (757)       | 15 127       |

|   |                     |                     |
|---|---------------------|---------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> |                     |                     |
|   | <b>(21 876 794)</b> | <b>(15 889 810)</b> |

| SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|--|--------------|--------------|
|  | GBP          | GBP          |

|  |              |           |
|--|--------------|-----------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |              |           |
| Investissements  | (11 326 856) | 7 831 274 |
| Contrats à terme standardisés                            | 52 701       | 116 681   |
| Conversions de change                                    | 2 857        | 7         |

|  |             |             |
|--|-------------|-------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |             |             |
| Investissements  | (4 452 776) | (3 320 549) |
| Contrats à terme standardisés                                    | (45 684)    | 51 460      |
| Conversions de change  | (570)       | 187         |

|   |                     |                  |
|---|---------------------|------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> |                     |                  |
|   | <b>(15 770 328)</b> | <b>4 679 060</b> |

| SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|--|--------------|--------------|
|  | USD          | USD          |

|  |             |             |
|--|-------------|-------------|
| <b>Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :</b> |             |             |
| Investissements  | 209 065 408 | 251 976 618 |
| Contrats à terme standardisés                            | (854 086)   | 434 901     |
| Conversions de change                                    | (9 786 619) | (2 978 082) |

|  |               |            |
|--|---------------|------------|
| <b>Variation nette des plus-values/(moins-values) latentes :</b> |               |            |
| Investissements  | (375 242 461) | 15 702 481 |
| Contrats à terme standardisés                                    | (234 822)     | 464 007    |
| Conversions de change  | 5 332 139     | 377 714    |

|   |                      |                    |
|---|----------------------|--------------------|
| <b>Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat</b> |                      |                    |
|   | <b>(171 720 441)</b> | <b>265 977 639</b> |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 9. VARIATIONS NETTES DE LA JUSTE VALEUR DES ACTIFS ET PASSIFS FINANCIERS À LA JUSTE VALEUR PAR LE BIAIS DU COMPTE DE RÉSULTAT (SUITE)

Exercices clôturés le 31 mars 2023 et le 31 mars 2022 (suite)

Plus-values/(Moins-values) nettes sur activités d'investissement (suite)

| Total   | 31 mars                | 31 mars              |
|---|------------------------|----------------------|
|   | 2023                   | 2022                 |
|   | USD                    | USD                  |
| Plus-values/(Moins-values) nettes réalisées sur :           |                        |                      |
| Investissements   | (409 501 256)          | 808 653 604          |
| Contrats à terme standardisés                               | (2 856 244)            | 601 427              |
| Conversions de change                                       | (67 665 695)           | (69 045 601)         |
| Titres TBA  | (2 812 811)            | (1 026 573)          |
| Variation nette des plus-values latentes sur :              |                        |                      |
| Investissements   | (3 228 667 968)        | (999 105 814)        |
| Contrats à terme standardisés                               | (999 913)              | 4 130 706            |
| Conversions de change                                       | 44 938 038             | 12 735 673           |
| Titres TBA  | 787 057                | (122 146)            |
| <b>(Moins-values) nettes sur activités d'investissement</b> | <b>(3 666 778 792)</b> | <b>(243 178 724)</b> |

### 10. GESTION EFFICACE DE PORTEFEUILLE

Les Compartiments peuvent, à des fins de gestion efficace de portefeuille, et conformément aux conditions et aux limites imposées par la Banque centrale, utiliser des instruments financiers dérivés (« IFD ») incluant des bons de souscription, des contrats à terme standardisés, ainsi que des contrats de change à terme incluant les contrats à terme non livrables. La gestion efficace de portefeuille consiste à prendre des décisions d'investissement qui impliquent de souscrire des transactions dans un ou plusieurs des buts suivants : réduire les risques, réduire les coûts ou générer une augmentation du capital ou des revenus d'un Compartiment avec un niveau de risque ajusté, en tenant compte du profil de risque du Compartiment. En particulier, les instruments financiers dérivés (IFD) peuvent être utilisés pour minimiser l'écart de suivi, c'est-à-dire le risque que le rendement du Compartiment diffère du rendement de l'Indice.

Dans la mesure où le Gestionnaire d'investissement utilise des IFD pour le compte d'un Compartiment, la volatilité du Compartiment risque d'augmenter. Le niveau de volatilité de chaque Compartiment devrait être étroitement corrélé avec la volatilité de l'Indice. Les investisseurs doivent noter que rien ne garantit que les niveaux historiques de volatilité de l'Indice continuent d'être observés dans le futur ou que le Compartiment présente par la suite un niveau de volatilité similaire. Il existe donc un risque que la volatilité du Compartiment soit relativement élevée par rapport à d'autres investissements, qu'elle puisse varier fortement au fil du temps et qu'un investissement dans le Compartiment puisse ne pas s'avérer approprié pour tous les investisseurs. Nonobstant cet avertissement, aucun Compartiment ne devrait avoir un profil de risque supérieur à la moyenne en raison de son utilisation d'IFD ou de son investissement dans des IFD. Les IFD seront utilisés dans les limites imposées par la Banque centrale et les positions prises à des fins de couverture ne pourront pas dépasser significativement la valeur des actifs qu'elles cherchent à couvrir. Bien qu'ils entraînent de manière inhérente la création d'un effet de levier, l'objectif principal de l'utilisation des IFD est de réduire l'écart de suivi. Par ailleurs, l'effet de levier résultant du recours aux IFD ne dépassera pas 100 % de la VL totale du Compartiment. L'effet de levier du Compartiment est mesuré conformément à l'approche d'engagement.

Sous réserve des restrictions imposées à l'utilisation des IFD décrites ci-dessus et de la Réglementation OPCVM, les Compartiments peuvent acheter et vendre des contrats à terme standardisés pour créer ou réduire une exposition à différents titres inclus dans l'Indice, ou pour réduire certains types de risques inhérents à des transactions spécifiques. Les contrats à terme standardisés sont des accords d'achat ou de vente caractérisés par un montant déterminé d'une obligation ou d'une devise à une date d'échéance déterminée. Les contrats à terme standardisés sont des instruments négociés en Bourse et leurs transactions sont soumises aux règles des marchés sur lesquels ils sont négociés. Les contrats de change à terme peuvent être utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille.

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 10. GESTION EFFICACE DE PORTEFEUILLE (SUITE)

Les contrats de change à terme peuvent, par exemple, être utilisés pour gérer les expositions de change représentées dans l'Indice. Les contrats de change à terme non livrables peuvent être utilisés pour les mêmes raisons. Ils se distinguent des contrats de change à terme standards en ce sens qu'au moins l'une des devises de la transaction n'est pas autorisée à être livrée en règlement de tout bénéfice ou de toute perte résultant de la transaction. Généralement, les bénéfices ou pertes dans ce cas seront livrés en dollar américain ou en euro.

Les Compartiments peuvent conclure des contrats à terme standardisés et des contrats de change à terme aux fins d'une gestion efficace de portefeuille. Les plus-values/(moins-values) associées à chaque instrument financier dérivé sont incluses dans l'État du résultat global, au poste des variations nettes de juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat. Les contreparties aux IFD sont identifiées dans le Tableau des investissements correspondant.

### 11. RISQUES FINANCIERS

Compte tenu de son statut de société d'investissement, la gestion des instruments financiers est fondamentale pour la gestion des affaires de la Société. Le Gestionnaire d'investissement est responsable, sous la supervision et le contrôle général du Conseil d'administration, de gérer les actifs et investissements des Compartiments de la Société conformément aux objectifs d'investissement et directives approuvé(e)s par le Conseil d'administration et aux politiques stipulées dans le Prospectus et les Suppléments.

La fonction de gestion des risques de la Société est attribuée à la Société de gestion, représentée en dernier ressort par le Conseil d'administration et est soutenue par l'Équipe de gestion des risques (« RMT », *Risk Management Team*) qui gère les risques au jour le jour sous la direction et la supervision de la Personne désignée de la Société de gestion, sous réserve d'un contrôle permanent par les Personnes désignées de la Société de gestion et les membres du Comité de direction. Le Conseil d'administration examine au moins une fois par an la politique et les procédures de gestion des risques en place et les Personnes désignées contrôlent en permanence les rapports préparés par l'équipe RMT. Le Conseil d'administration et les Personnes désignées peuvent émettre des lignes directrices sur les risques qui seront contraignantes pour les Gestionnaires d'investissement. Actuellement, les lignes directrices comprennent le suivi et la mise en évidence de tout écart par rapport à l'objectif et à la politique d'investissement de chaque Compartiment et la garantie que l'exposition globale de chaque Compartiment est maintenue dans les paramètres définis par la Banque centrale d'Irlande. L'équipe RMT surveille ces directives et les Gestionnaires d'investissement effectuent également ces examens dans le cadre de leurs fonctions de supervision et de gestion de portefeuille.

Les activités menées par la Société l'exposent à différents risques financiers : le risque de marché (comprenant le risque de prix du marché, le risque de change et le risque lié aux taux d'intérêt), le risque de liquidité et le risque de crédit.

Aucun changement n'a été apporté au processus de gestion des investissements des Compartiments depuis l'exercice précédent.

Plus spécifiquement, la capacité d'un Compartiment à obtenir une corrélation importante entre la performance du Compartiment et celle de l'indice qu'il suit peut être affectée par des fluctuations des marchés de titres, des modifications dans la composition de l'indice, des flux de trésorerie entrants et sortants du Compartiment, et des commissions et dépenses du Compartiment. Chaque Compartiment cherchera à répliquer les rendements de l'indice, quelle que soit la performance actuelle ou prévue de l'indice ou des titres le composant. La performance de chaque Compartiment peut donc s'avérer moins favorable que celle d'un portefeuille géré selon une stratégie d'investissement active. La structure et la composition de l'indice affecteront la performance, la volatilité et le risque de l'indice (en termes absolus et par comparaison avec d'autres indices), et donc la performance, la volatilité et le risque du Compartiment. Dans la mesure où les Compartiments cherchent à répliquer les rendements de l'indice indépendamment de la performance actuelle ou prévisionnelle, les risques financiers ne sont pas activement gérés.

Les informations suivantes n'ont pas vocation à représenter l'exhaustivité des risques, et les investisseurs sont invités à se reporter au Prospectus et aux Suppléments pour obtenir des précisions sur les risques liés à l'investissement dans la Société.

#### Risque de marché

##### *Risque de prix de marché*

Les Compartiments sont exposés au risque de prix pour les actions et titres à revenu fixe et au risque de prix pour les produits dérivés. Ceci résulte du fait que les prix futurs des investissements détenus par les Compartiments sont incertains. Les investissements d'un Compartiment sont soumis à la conjoncture économique générale, aux fluctuations normales des marchés et aux risques inhérents à un investissement sur les marchés de titres internationaux.

L'exposition du Compartiment au risque de prix de marché correspond à la valeur totale des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat, telle qu'elle est présentée dans chaque État de la situation financière.

La sensibilité des Compartiments aux fluctuations des cours du marché, dans un contexte d'augmentation de 10 %, est décrite dans le tableau ci-dessous :

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

##### Risque de prix de marché (suite)

| 31 mars 2023  | Devise | Augmentation de la VL estimée |
|---|--------|-------------------------------|
| SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF       | EUR    | 129 306 243                   |
| SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF       | USD    | 17 774 879                    |
| SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF                   | USD    | 25 543 091                    |
| SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF      | EUR    | 62 002 680                    |
| SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF        | USD    | 9 556 571                     |
| SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF      | USD    | 16 371 072                    |
| SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF        | USD    | 88 348 761                    |
| SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF                | EUR    | 48 555 241                    |
| SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF               | EUR    | 106 512 456                   |
| SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF               | EUR    | 43 244 754                    |
| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF              | USD    | 279 389 943                   |
| SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF                          | USD    | 35 417 727                    |
| SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF                 | USD    | 49 520 243                    |
| SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF                | USD    | 1 934 143                     |
| SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF            | EUR    | 7 466 904                     |
| SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF            | USD    | 700 732 281                   |
| SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF | USD    | 18 852 772                    |
| SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF                 | USD    | 26 191 092                    |
| SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF           | EUR    | 3 927 515                     |
| SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF                          | GBP    | 68 806 472                    |
| SPDR MSCI ACWI UCITS ETF                                    | USD    | 275 748 794                   |
| SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF                                 | USD    | 103 747 447                   |

| 31 mars 2023   | Devise | Augmentation de la VL estimée |
|--|--------|-------------------------------|
| SPDR MSCI EMU UCITS ETF                                  | EUR    | 23 706 312                    |
| SPDR MSCI Japan UCITS ETF                                | JPY    | 4 057 354 705                 |
| SPDR MSCI World UCITS ETF                                | USD    | 230 892 837                   |
| SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF                      | USD    | 166 994 055                   |
| SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF**                     | USD    | 76 853 094                    |
| SPDR S&P 500 UCITS ETF                                   | USD    | 544 946 830                   |
| SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF                    | USD    | 16 091 852                    |
| SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF | USD    | 20 623 594                    |
| SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF             | EUR    | 134 463 097                   |
| SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF           | USD    | 130 204 750                   |
| SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF         | USD    | 13 572 863                    |
| SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF             | GBP    | 11 949 814                    |
| SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF             | USD    | 510 742 363                   |

\*\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

Une baisse de 10 % des prix de marché aurait eu un effet négatif similaire. Les sensibilités estimées ci-dessus le sont uniquement à des fins d'illustration et ne sont pas censées être prédictives. Les fluctuations réelles découlant des variations des prix de marché peuvent différer considérablement de celles indiquées ci-dessus.

| 31 mars 2022   | Devise | Augmentation de la VL estimée |
|--|--------|-------------------------------|
| SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF  | EUR    | 147 253 166                   |
| SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF  | USD    | 12 198 900                    |
| SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF              | USD    | 11 002 114                    |
| SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF | EUR    | 70 722 273                    |
| SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF   | USD    | 13 998 428                    |
| SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF | USD    | 7 152 146                     |



## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

##### Risque de prix de marché (suite)

| 31 mars 2022  | Devise | Augmentation de la VL estimée |
|---|--------|-------------------------------|
| SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF          | USD    | 156 165 595                   |
| SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF                  | EUR    | 55 460 985                    |
| SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF                 | EUR    | 112 029 085                   |
| SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF                 | EUR    | 56 122 057                    |
| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF                | USD    | 164 854 258                   |
| SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF                            | USD    | 41 605 076                    |
| SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF                   | USD    | 52 723 634                    |
| SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF*                 | USD    | S/O                           |
| SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF              | EUR    | 7 229 812                     |
| SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF              | USD    | 714 104 942                   |
| SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF** | USD    | 13 342 184                    |
| SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF                   | USD    | 34 746 463                    |
| SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF             | EUR    | 6 000 343                     |
| SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF                            | GBP    | 67 885 168                    |
| SPDR MSCI ACWI UCITS ETF                                      | USD    | 331 144 281                   |

| 31 mars 2022   | Devise | Augmentation de la VL estimée |
|--|--------|-------------------------------|
| SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF                              | USD    | 114 116 568                   |
| SPDR MSCI EMU UCITS ETF                                  | EUR    | 24 712 025                    |
| SPDR MSCI Japan UCITS ETF                                | JPY    | 3 296 284 537                 |
| SPDR MSCI World UCITS ETF                                | USD    | 146 930 707                   |
| SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF                      | USD    | 136 651 990                   |
| SPDR S&P 500 ESG Screened UCITS ETF****                  | USD    | 57 967 683                    |
| SPDR S&P 500 UCITS ETF                                   | USD    | 655 235 077                   |
| SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF                    | USD    | 19 103 248                    |
| SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF | USD    | 1 108 519                     |
| SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF             | EUR    | 120 362 487                   |
| SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF           | USD    | 128 644 276                   |
| SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF         | USD    | 15 749 990                    |
| SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF             | GBP    | 12 059 049                    |
| SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF             | USD    | 407 044 372                   |

\* Le Compartiment a été lancé le 10 novembre 2021.

\*\* Le nom du Compartiment a changé le 29 octobre 2021.

\*\*\*\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022.

#### Risque de change

Les Compartiments ont des activités internationales et peuvent détenir des actifs monétaires et non-monétaires libellés dans d'autres devises que leurs devises fonctionnelles respectives. Le risque de change apparaît lorsque la valeur des transactions futures, des actifs et passifs monétaires comptabilisés libellés dans d'autres devises fluctue en raison des variations des taux de change.

Un Compartiment peut, sans y être pour autant contraint, investir dans des contrats de change pour contribuer à réduire son exposition à différentes devises, mais il n'existe aucune garantie que ces contrats permettront d'atteindre cet objectif. Ces contrats peuvent aussi réduire ou éliminer tout ou partie du bénéfice qu'un Compartiment peut tirer de fluctuations de change favorables.

Ces informations sont une estimation relative du risque et n'ont pas vocation à être un chiffre précis et exact car ils ne peuvent pas prévoir si ces soldes varieront de plus ou moins 5 %.

L'exposition des Compartiments à des devises autres que leur devise fonctionnelle figure dans les tableaux ci-dessous

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

#### Risque de change (suite)

31 mars 2023

#### SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|------------------------------|---|--|---|
| <b>Exposition en devises</b> |   |  |   |
| Euro                         | 15                                      | -  | 15  |
|                              | <b>15</b>                               | <b>-</b>                                       | <b>15</b>                                       |

#### SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b> |   |   |   |
| Euro                         | 7 317                                   | -   | 7 317   |
| Peso mexicain                | 12 749 003                              | -   | 12 749 003                                      |
|                              | <b>12 756 320</b>                       | <b>-</b>                                    | <b>12 756 320</b>                               |

#### SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b> |   |   |   |
| Euro                         | 876                                     | -   | 876   |
|                              | <b>876</b>                              | <b>-</b>                                    | <b>876</b>                                      |

#### SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b> |   |   |   |
| Euro                         | 155                                     | -   | 155   |
|                              | <b>155</b>                              | <b>-</b>                                    | <b>155</b>                                      |

#### SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b> |   |   |   |
| Réal brésilien               | 211 234 489                             | -   | 211 234 489                                     |
| Peso chilien                 | 44 404 937                              | -   | 44 404 937                                      |
| Yuan Renminbi de Chine       | 250 117 374                             | -   | 250 117 374                                     |
| Yuan chinois offshore        | 4 077 294                               | -   | 4 077 294                                       |
| Peso colombien               | 66 984 627                              | -   | 66 984 627                                      |
| Couronne tchèque             | 106 058 262                             | -   | 106 058 262                                     |
| Euro                         | 193 909 763                             | -   | 193 909 763                                     |
| Forint hongrois              | 48 950 672                              | -   | 48 950 672                                      |
| Roupie indonésienne          | 256 862 996                             | -   | 256 862 996                                     |
| Nouveau shekel israélien     | 85 474 955                              | -   | 85 474 955                                      |
| Ringgit malais               | 256 185 379                             | -   | 256 185 379                                     |
| Peso mexicain                | 247 591 118                             | -   | 247 591 118                                     |
| Sol péruvien                 | 38 398 407                              | -   | 38 398 407                                      |
| Peso philippin               | 107 283 496                             | -   | 107 283 496                                     |
| Zloty polonais               | 121 600 920                             | -   | 121 600 920                                     |
| Leu roumain                  | 57 238 622                              | -   | 57 238 622                                      |
| Rouble russe                 | (254)                                   | -   | (254)   |
| Rand sud-africain            | 164 555 216                             | -   | 164 555 216                                     |
| Won sud-coréen               | 262 118 183                             | -   | 262 118 183                                     |
| Baht thaïlandais             | 229 685 445                             | -   | 229 685 445                                     |
| Lire turque                  | 45 296 949                              | -   | 45 296 949                                      |
|                              | <b>2 798 028 850</b>                    | <b>-</b>                                    | <b>2 798 028 850</b>                            |

#### SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b> |   |   |   |
| Dollar australien            | 5 676 093                               | -   | 5 676 093                                       |
| Livre sterling               | 60 502 888                              | -   | 60 502 888                                      |
| Dollar canadien              | 10 505 593                              | -   | 10 505 593                                      |
| Peso chilien                 | 1 162 152                               | -   | 1 162 152                                       |
| Yuan Renminbi de Chine       | 32 988 324                              | -   | 32 988 324                                      |
| Yuan chinois offshore        | (775 923)                               | -   | (775 923)                                       |
| Peso colombien               | 701 562                                 | -   | 701 562   |
| Couronne tchèque             | 778 268                                 | -   | 778 268   |
| Couronne danoise             | 675 474                                 | -   | 675 474   |
| Euro                         | 512 860 910                             | -   | 512 860 910                                     |
| Dollar de Hong Kong          | 16 029                                  | -   | 16 029  |
| Forint hongrois              | 670 884                                 | -   | 670 884   |
| Roupie indonésienne          | 1 520 522                               | -   | 1 520 522                                       |
| Nouveau shekel israélien     | 56 461                                  | -   | 56 461  |
| Yen japonais                 | 45 609 582                              | -   | 45 609 582                                      |
| Ringgit malais               | 1 565 583                               | -   | 1 565 583                                       |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

#### Risque de change (suite)

31 mars 2023 (suite)

#### SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF (suite)

|                      | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|----------------------|---|---|---|
| Peso mexicain        | 1 395 267                               | -   | 1 395 267                                       |
| Dollar néo-zélandais | 665 801                                 | -   | 665 801   |
| Couronne norvégienne | 711 317                                 | -   | 711 317   |
| Sol péruvien         | 612 942                                 | -   | 612 942   |
| Zloty polonais       | 615 425                                 | -   | 615 425   |
| Leu roumain          | 965 788                                 | -   | 965 788   |
| Dollar de Singapour  | 839 402                                 | -   | 839 402   |
| Won sud-coréen       | 3 961 782                               | -   | 3 961 782                                       |
| Couronne suédoise    | 1 048 044                               | -   | 1 048 044                                       |
| Franc suisse         | 818 647 954                             | -   | 818 647 954                                     |
| Baht thaïlandais     | 1 363 923                               | -   | 1 363 923                                       |
|                      | <b>1 505 342 047</b>                    |   | <b>1 505 342 047</b>                            |

#### SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF

|                       | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|-----------------------|---|---|---|
| Exposition en devises |   |   |   |
| Euro                  | 3 310                                   | -   | 3 310   |
|                       | <b>3 310</b>                            |   | <b>3 310</b>                                    |

#### SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF

|                       | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|-----------------------|---|---|---|
| Exposition en devises |   |   |   |
| Livre sterling        | 111                                     | -   | 111   |
| Euro                  | 498                                     | -   | 498   |
|                       | <b>609</b>                              |   | <b>609</b>                                      |

#### SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF

|                        | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|------------------------|---|---|---|
| Exposition en devises  |   |   |   |
| Yuan renminbi de Chine | 19 832 208                              | -   | 19 832 208                                      |
|                        | <b>19 832 208</b>                       |   | <b>19 832 208</b>                               |

#### SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

|                       | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|-----------------------|---|---|---|
| Exposition en devises |   |   |   |
| Euro                  | 277 081 777                             | -   | 277 081 777                                     |
|                       | <b>277 081 777</b>                      |   | <b>277 081 777</b>                              |

#### SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

|                       | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|-----------------------|---|---|---|
| Exposition en devises |   |   |   |
| Euro                  | 53 161 244                              | -   | 53 161 244                                      |
|                       | <b>53 161 244</b>                       |   | <b>53 161 244</b>                               |

#### SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF

|                          | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|--------------------------|---|---|---|
| Exposition en devises    |   |   |   |
| Dollar australien        | (32 983)                                | 7 037 199                                   | 7 004 216                                       |
| Réal brésilien           | 7 435                                   | 688 358                                     | 695 793   |
| Livre sterling           | 123 734                                 | 10 128 979                                  | 10 252 713                                      |
| Dollar canadien          | 12 929                                  | 3 011 420                                   | 3 024 349                                       |
| Euro                     | 114 737                                 | 8 467 010                                   | 8 581 747                                       |
| Dollar de Hong Kong      | 5 815                                   | 6 428 878                                   | 6 434 693                                       |
| Nouveau shekel israélien | 688                                     | 406 725                                     | 407 413   |
| Yen japonais             | 237 762                                 | 23 895 409                                  | 24 133 171                                      |
| Peso mexicain            | 8 550                                   | 1 180 050                                   | 1 188 600                                       |
| Dollar néo-zélandais     | 267                                     | -   | 267   |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

#### Risque de change (suite)

31 mars 2023 (suite)

#### SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF (suite)

|                      | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|----------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|                      | USD                              | USD                                  | USD                                      |
| Couronne norvégienne | 1                                | -                                    | 1  |
| Peso philippin       | 395                              | -                                    | 395                                      |
| Zloty polonais       | 686                              | -                                    | 686                                      |
| Riyal saoudien       | 37 456                           | 146 885                              | 184 341                                  |
| Dollar de Singapour  | 11 285                           | 8 847 279                            | 8 858 564                                |
| Rand sud-africain    | 30 756                           | 996 933                              | 1 027 689                                |
| Couronne suédoise    | 12 209                           | 2 943 388                            | 2 955 597                                |
| Franc suisse         | 46 418                           | 2 284 161                            | 2 330 579                                |
| Baht thaïlandais     | 8 192                            | 486 055                              | 494 247                                  |
| Lire turque          | 362                              | -                                    | 362                                      |
|                      | <b>626 694</b>                   | <b>76 948 729</b>                    | <b>77 575 423</b>                        |

#### SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|                              | EUR                              | EUR                                  | EUR                                      |
| <b>Exposition en devises</b> |                                  |                                      |  |
| Livre sterling               | 218                              | -                                    | 218                                      |
| Couronne danoise             | 275                              | -                                    | 275                                      |
| Couronne norvégienne         | 12 357                           | 151 306                              | 163 663                                  |
| Couronne suédoise            | 25 858                           | 7 208 942                            | 7 234 800                                |
| Franc suisse                 | 69 154                           | 4 966 246                            | 5 035 400                                |
| Dollar américain             | 603                              | -                                    | 603                                      |
|                              | <b>108 465</b>                   | <b>12 326 494</b>                    | <b>12 434 959</b>                        |

#### SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|                              | GBP                              | GBP                                  | GBP                                      |
| <b>Exposition en devises</b> |                                  |                                      |  |
| Euro                         | 139 333                          | -                                    | 139 333                                  |
| Dollar américain             | 1 990 010                        | -                                    | 1 990 010                                |
|                              | <b>2 129 343</b>                 | <b>-</b>                             | <b>2 129 343</b>                         |

#### SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

|                                   | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|-----------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|                                   | USD                              | USD                                  | USD                                      |
| <b>Exposition en devises</b>      |                                  |                                      |  |
| Dollar australien                 | (7 573 676)                      | 50 021 408                           | 42 447 732                               |
| Réal brésilien                    | 142 010                          | 13 617 452                           | 13 759 462                               |
| Livre sterling                    | (15 970 503)                     | 100 260 843                          | 84 290 340                               |
| Dollar canadien                   | (12 455 127)                     | 79 254 409                           | 66 799 282                               |
| Peso chilien                      | 53 823                           | 1 079 637                            | 1 133 460                                |
| Yuan Renminbi de Chine            | 3 273                            | 14 019 757                           | 14 023 030                               |
| Peso colombien                    | 4 639                            | 275 864                              | 280 503                                  |
| Couronne tchèque                  | 21 135                           | 760 955                              | 782 090                                  |
| Couronne danoise                  | (2 793 156)                      | 21 336 135                           | 18 542 979                               |
| Livre égyptienne                  | -                                | 214 556                              | 214 556                                  |
| Euro                              | 300 590 194                      | 225 982 246                          | 526 572 440                              |
| Dollar de Hong Kong               | (2 853 378)                      | 89 467 951                           | 86 614 573                               |
| Forint hongrois                   | 41 171                           | 411 346                              | 452 517                                  |
| Roupie indienne                   | 104 624                          | 34 331 579                           | 34 436 203                               |
| Roupie indonésienne               | 149 697                          | 6 110 237                            | 6 259 934                                |
| Nouveau shekel israélien          | (768 808)                        | 2 314 186                            | 1 545 378                                |
| Yen japonais                      | (21 479 707)                     | 143 232 641                          | 121 752 934                              |
| Dinar koweïtien                   | 36 405                           | 2 268 237                            | 2 304 642                                |
| Ringgit malais                    | 130 933                          | 3 838 531                            | 3 969 464                                |
| Peso mexicain                     | 83 765                           | 7 354 106                            | 7 437 871                                |
| Nouveau dollar de<br>Taïwan       | 149 044                          | 43 695 600                           | 43 844 644                               |
| Dollar néo-zélandais              | (34 188)                         | 1 498 079                            | 1 463 891                                |
| Couronne norvégienne              | (746 456)                        | 4 632 066                            | 3 885 610                                |
| Peso philippin                    | 19 044                           | 1 405 862                            | 1 424 906                                |
| Zloty polonais                    | 22 592                           | 1 700 631                            | 1 723 223                                |
| Riyal qatari                      | 55 506                           | 1 765 905                            | 1 821 411                                |
| Riyal saoudien                    | 136 456                          | 11 141 122                           | 11 277 578                               |
| Dollar de Singapour               | (1 719 052)                      | 9 299 866                            | 7 580 814                                |
| Rand sud-africain                 | 170 901                          | 9 762 071                            | 9 932 972                                |
| Won sud-coréen                    | 379 941                          | 33 696 070                           | 34 076 011                               |
| Couronne suédoise                 | (3 525 317)                      | 21 966 795                           | 18 441 478                               |
| Franc suisse                      | (10 604 564)                     | 66 346 162                           | 55 741 598                               |
| Baht thaïlandais                  | 101 363                          | 5 457 416                            | 5 558 779                                |
| Lire turque                       | 47 562                           | 1 440 347                            | 1 487 909                                |
| Dirham des Émirats<br>arabes unis | 165 047                          | 3 839 312                            | 4 004 359                                |
|                                   | <b>222 085 193</b>               | <b>1 013 799 380</b>                 | <b>1 235 884 573</b>                     |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

#### Risque de change (suite)

31 mars 2023 (suite)

#### SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|                              | USD                              | USD                                  | USD                                      |
| <b>Exposition en devises</b> |                                  |                                      |  |
| Yuan renminbi de Chine       | 2                                | 67 084 428                           | 67 084 430                               |
| Euro                         | 1 660                            | -                                    | 1 660                                    |
| Dollar de Hong Kong          | (34 557)                         | 320 752 881                          | 320 718 324                              |
| Roupie indienne              | 340 458                          | 167 194 694                          | 167 535 152                              |
| Roupie indonésienne          | 446 857                          | 22 333 165                           | 22 780 022                               |
| Ringgit malais               | 310 671                          | 18 821 651                           | 19 132 322                               |
| Nouveau dollar de<br>Taiwan  | 779 369                          | 193 847 084                          | 194 626 453                              |
| Roupie pakistanaise          | 554                              | -                                    | 554                                      |
| Peso philippin               | 73 077                           | 9 152 051                            | 9 225 128                                |
| Won sud-coréen               | 2 218 908                        | 141 347 070                          | 143 565 978                              |
| Baht thaïlandais             | 464 258                          | 27 096 218                           | 27 560 476                               |
|                              | <b>4 601 257</b>                 | <b>967 629 242</b>                   | <b>972 230 499</b>                       |

#### SPDR MSCI EMU UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|                              | EUR                              | EUR                                  | EUR                                      |
| <b>Exposition en devises</b> |                                  |                                      |  |
| Livre sterling               | 5                                | -                                    | 5  |
| Dollar américain             | 91 322                           | 838 371                              | 929 693                                  |
|                              | <b>91 327</b>                    | <b>838 371</b>                       | <b>929 698</b>                           |

#### SPDR MSCI Japan UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|                              | JPY                              | JPY                                  | JPY                                      |
| <b>Exposition en devises</b> |                                  |                                      |  |
| Euro                         | 2 498 929 592                    | -                                    | 2 498 929 592                            |
|                              | <b>2 498 929 592</b>             | <b>-</b>                             | <b>2 498 929 592</b>                     |

#### SPDR MSCI World UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|                              | USD                              | USD                                  | USD                                      |
| <b>Exposition en devises</b> |                                  |                                      |  |
| Dollar australien            |                                  |                                      |  |
|                              | 702 087                          | 47 509 697                           | 48 211 784                               |
| Livre sterling               | 918 882                          | 94 372 705                           | 95 291 587                               |
| Dollar canadien              | 380 721                          | 74 162 654                           | 74 543 375                               |
| Couronne danoise             | 353 187                          | 19 808 006                           | 20 161 193                               |
| Euro                         | 1 089 541                        | 216 952 795                          | 218 042 336                              |
| Dollar de Hong Kong          | 80 838                           | 16 724 037                           | 16 804 875                               |
| Nouveau shekel israélien     | 31 822                           | 2 771 741                            | 2 803 563                                |
| Yen japonais                 | 1 634 275                        | 137 881 980                          | 139 516 255                              |
| Dollar néo-zélandais         | 28 106                           | 1 311 449                            | 1 339 555                                |
| Couronne norvégienne         | 101 174                          | 4 348 795                            | 4 449 969                                |
| Dollar de Singapour          | 116 824                          | 8 116 410                            | 8 233 234                                |
| Couronne suédoise            | 268 618                          | 21 424 807                           | 21 693 425                               |
| Franc suisse                 | 384 807                          | 63 628 040                           | 64 012 847                               |
|                              | <b>6 090 882</b>                 | <b>709 013 116</b>                   | <b>715 103 998</b>                       |

#### SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|                              | USD                              | USD                                  | USD                                      |
| <b>Exposition en devises</b> |                                  |                                      |  |
| Euro                         | 461                              | -                                    | 461                                      |
|                              | <b>461</b>                       | <b>-</b>                             | <b>461</b>                               |

#### SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF\*

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|                              | USD                              | USD                                  | USD                                      |
| <b>Exposition en devises</b> |                                  |                                      |  |
| Euro                         | 1 638                            | -                                    | 1 638                                    |
|                              | <b>1 638</b>                     | <b>-</b>                             | <b>1 638</b>                             |

\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

#### SPDR S&P 500 UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|                              | USD                              | USD                                  | USD                                      |
| <b>Exposition en devises</b> |                                  |                                      |  |
| Euro                         | 449 980 946                      | -                                    | 449 980 946                              |
|                              | <b>449 980 946</b>               | <b>-</b>                             | <b>449 980 946</b>                       |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

#### Risque de change (suite)

31 mars 2023 (suite)

#### SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF

|  | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|--|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|  | USD                              | USD                                  | USD                                      |

#### Exposition en devises

|      |              |          |              |
|------|--------------|----------|--------------|
| Euro | 3 091        | -        | 3 091        |
|      | <b>3 091</b> | <b>-</b> | <b>3 091</b> |

#### SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF

|  | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|--|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|  | USD                              | USD                                  | USD                                      |

#### Exposition en devises

|                                |                  |                    |                    |
|--------------------------------|------------------|--------------------|--------------------|
| Réal brésilien                 | 6 076            | -                  | 6 076              |
| Livre sterling                 | 275              | -                  | 275                |
| Peso chilien                   | 7 712            | -                  | 7 712              |
| Yuan Renminbi de Chine         | 5 100            | -                  | 5 100              |
| Peso colombien                 | 132              | -                  | 132                |
| Couronne tchèque               | 794              | -                  | 794                |
| Livre égyptienne               | 6                | -                  | 6                  |
| Euro                           | 691              | -                  | 691                |
| Dollar de Hong Kong            | 13 974           | 50 943 436         | 50 957 410         |
| Forint hongrois                | 9                | -                  | 9                  |
| Roupie indienne                | 2 183            | -                  | 2 183              |
| Roupie indonésienne            | 10 090           | -                  | 10 090             |
| Dinar koweïtien                | 2 669            | -                  | 2 669              |
| Ringgit malais                 | 15 516           | 560 600            | 576 116            |
| Peso mexicain                  | 8 953            | 5 607 242          | 5 616 195          |
| Dirham marocain                | 3                | -                  | 3                  |
| Nouveau dollar de Taiwan       | 97 700           | 33 512 709         | 33 610 409         |
| Peso philippin                 | 17 299           | 710 730            | 728 029            |
| Zloty polonais                 | 4 168            | -                  | 4 168              |
| Riyal qatari                   | 6 959            | -                  | 6 959              |
| Riyal saoudien                 | 57 126           | 6 715 072          | 6 772 198          |
| Dollar de Singapour            | 253              | -                  | 253                |
| Rand sud-africain              | 16 970           | -                  | 16 970             |
| Won sud-coréen                 | 1 073 394        | 23 454 369         | 24 527 763         |
| Baht thaïlandais               | 20 768           | -                  | 20 768             |
| Lire turque                    | 137 435          | 4 312 814          | 4 450 249          |
| Dirham des Émirats arabes unis | 19 776           | -                  | 19 776             |
|                                | <b>1 526 031</b> | <b>125 816 972</b> | <b>127 343 003</b> |

#### SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF

|  | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|--|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|  | EUR                              | EUR                                  | EUR                                      |

#### Exposition en devises

|                  |                |          |                |
|------------------|----------------|----------|----------------|
| Livre sterling   | 26 647         | -        | 26 647         |
| Dollar américain | 797 984        | -        | 797 984        |
|                  | <b>824 631</b> | <b>-</b> | <b>824 631</b> |

#### SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF

|  | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|--|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|  | USD                              | USD                                  | USD                                      |

#### Exposition en devises

|                                |                  |                    |                    |
|--------------------------------|------------------|--------------------|--------------------|
| Dollar australien              | 211 566          | 18 619 937         | 18 831 503         |
| Livre sterling                 | (1 943 231)      | 92 769 682         | 90 826 451         |
| Dollar canadien                | (2 749 425)      | 114 604 410        | 111 854 985        |
| Couronne danoise               | 9 427            | -                  | 9 427              |
| Euro                           | 13 016 553       | 89 216 367         | 102 232 920        |
| Dollar de Hong Kong            | (2 966 209)      | 100 371 990        | 97 405 781         |
| Yen japonais                   | (122 657)        | 84 299 584         | 84 176 927         |
| Nouveau dollar de Taiwan       | (621 815)        | 17 724 717         | 17 102 902         |
| Riyal saoudien                 | 164 583          | 13 147 437         | 13 312 020         |
| Dollar de Singapour            | (482 373)        | 16 165 608         | 15 683 235         |
| Rand sud-africain              | 54               | -                  | 54                 |
| Won sud-coréen                 | 486 438          | 12 814 769         | 13 301 207         |
| Franc suisse                   | (2 529 167)      | 80 668 769         | 78 139 602         |
| Baht thaïlandais               | 11               | -                  | 11                 |
| Dirham des Émirats arabes unis | (1 590)          | -                  | (1 590)            |
|                                | <b>2 472 165</b> | <b>640 403 270</b> | <b>642 875 435</b> |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

#### Risque de change (suite)

31 mars 2023 (suite)

#### SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b> |   |   |   |
| Dollar australien            | 445 598                                 | 19 724 172                                  | 20 169 770                                      |
| Dollar de Hong Kong          | 175 925                                 | 49 231 589                                  | 49 407 514                                      |
| Roupie indienne              | 4 421                                   | 1 263 605                                   | 1 268 026                                       |
| Roupie indonésienne          | 32 451                                  | 1 238 054                                   | 1 270 505                                       |
| Yen japonais                 | 809 503                                 | 41 573 706                                  | 42 383 209                                      |
| Ringgit malais               | 909                                     | -   | 909   |
| Nouveau dollar de<br>Taiwan  | 18 351                                  | 13 514 951                                  | 13 533 302                                      |
| Dollar néo-zélandais         | 24 583                                  | 2 926 983                                   | 2 951 566                                       |
| Peso philippin               | 81 282                                  | 2 097 965                                   | 2 179 247                                       |
| Dollar de Singapour          | 2 522                                   | -   | 2 522   |
| Won sud-coréen               | 5 362                                   | 1 048 016                                   | 1 053 378                                       |
| Baht thaïlandais             | 5 219                                   | 993 347                                     | 998 566   |
|                              | <b>1 606 126</b>                        | <b>133 612 388</b>                          | <b>135 218 514</b>                              |

#### SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>GBP | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>GBP | Actifs/Passif<br>s<br>financiers<br>nets<br>GBP |
|------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b> |   |   |   |
| Dollar américain             | 89 750                                  | -   | 89 750  |
|                              | <b>89 750</b>                           | <b>-</b>                                    | <b>89 750</b>                                   |

#### SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b> |   |   |   |
| Euro                         | 212 096 979                             | -   | 212 096 979                                     |
|                              | <b>212 096 979</b>                      | <b>-</b>                                    | <b>212 096 979</b>                              |

31 mars 2022

#### SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b> |   |   |   |
| Peso mexicain                | 12 546 812                              | -   | 12 546 812                                      |
|                              | <b>12 546 812</b>                       | <b>-</b>                                    | <b>12 546 812</b>                               |

#### SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b> |   |   |   |
| Réal brésilien               | 271 767 161                             | -   | 271 767 161                                     |
| Peso chilien                 | 45 804 349                              | -   | 45 804 349                                      |
| Yuan chinois offshore        | 4 410 672                               | -   | 4 410 672                                       |
| Yuan Renminbi de Chine       | 304 710 771                             | -   | 304 710 771                                     |
| Peso colombien               | 89 567 371                              | -   | 89 567 371                                      |
| Couronne tchèque             | 110 295 965                             | -   | 110 295 965                                     |
| Euro                         | 294 787 851                             | -   | 294 787 851                                     |
| Forint hongrois              | 65 472 571                              | -   | 65 472 571                                      |
| Roupie indonésienne          | 303 343 881                             | -   | 303 343 881                                     |
| Nouveau shekel israélien     | 131 418 780                             | -   | 131 418 780                                     |
| Yen japonais                 | 194 689                                 | -   | 194 689   |
| Ringgit malais               | 297 449 190                             | -   | 297 449 190                                     |
| Peso mexicain                | 234 980 603                             | -   | 234 980 603                                     |
| Sol péruvien                 | 48 084 789                              | -   | 48 084 789                                      |
| Peso philippin               | 109 760 610                             | -   | 109 760 610                                     |
| Zloty polonais               | 139 382 460                             | -   | 139 382 460                                     |
| Leu roumain                  | 61 835 529                              | -   | 61 835 529                                      |
| Rand sud-africain            | 229 022 453                             | -   | 229 022 453                                     |
| Won sud-coréen               | 302 838 504                             | -   | 302 838 504                                     |
| Baht thaïlandais             | 252 539 972                             | -   | 252 539 972                                     |
| Lire turque                  | 24 341 294                              | -   | 24 341 294                                      |
|                              | <b>3 322 009 465</b>                    | <b>-</b>                                    | <b>3 322 009 465</b>                            |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

#### Risque de change (suite)

31 mars 2022 (suite)

#### SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|                              | USD                              | USD                                  | USD                                      |
| <b>Exposition en devises</b> |                                  |                                      |  |
| Dollar australien            | 5 433 040                        | -                                    | 5 433 040                                |
| Livre sterling               | 56 817 996                       | -                                    | 56 817 996                               |
| Dollar canadien              | 12 051 214                       | -                                    | 12 051 214                               |
| Peso chilien                 | 715 410                          | -                                    | 715 410                                  |
| Yuan chinois offshore        | (114 678 250)                    | -                                    | (114 678 250)                            |
| Yuan Renminbi de Chine       | 151 288 901                      | -                                    | 151 288 901                              |
| Peso colombien               | 472 609                          | -                                    | 472 609                                  |
| Couronne tchèque             | 651 544                          | -                                    | 651 544                                  |
| Couronne danoise             | 1 658 813                        | -                                    | 1 658 813                                |
| Euro                         | 340 135 337                      | -                                    | 340 135 337                              |
| Dollar de Hong Kong          | 16 878                           | -                                    | 16 878                                   |
| Forint hongrois              | 697 401                          | -                                    | 697 401                                  |
| Roupie indonésienne          | 2 295 383                        | -                                    | 2 295 383                                |
| Nouveau shekel israélien     | 594 305                          | -                                    | 594 305                                  |
| Yen japonais                 | 53 489 036                       | -                                    | 53 489 036                               |
| Ringgit malais               | 1 772 715                        | -                                    | 1 772 715                                |
| Peso mexicain                | 792 255                          | -                                    | 792 255                                  |
| Dollar néo-zélandais         | 1 064 196                        | -                                    | 1 064 196                                |
| Couronne norvégienne         | 821 710                          | -                                    | 821 710                                  |
| Sol péruvien                 | 373 912                          | -                                    | 373 912                                  |
| Zloty polonais               | 529 543                          | -                                    | 529 543                                  |
| Leu roumain                  | 663 140                          | -                                    | 663 140                                  |
| Dollar de Singapour          | 1 434 119                        | -                                    | 1 434 119                                |
| Won sud-coréen               | 4 989 449                        | -                                    | 4 989 449                                |
| Couronne suédoise            | 2 446 282                        | -                                    | 2 446 282                                |
| Franc suisse                 | 153 365 112                      | -                                    | 153 365 112                              |
| Baht thaïlandais             | 1 978 840                        | -                                    | 1 978 840                                |
|                              | <b>681 870 890</b>               | <b>-</b>                             | <b>681 870 890</b>                       |

#### SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|                              | USD                              | USD                                  | USD                                      |
| <b>Exposition en devises</b> |                                  |                                      |  |
| Livre sterling               | 117                              | -                                    | 117                                      |
| Euro                         | (4)                              | -                                    | (4)                                      |
|                              | <b>113</b>                       | <b>-</b>                             | <b>113</b>                               |

#### SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|                              | USD                              | USD                                  | USD                                      |
| <b>Exposition en devises</b> |                                  |                                      |  |
| Yuan renminbi de Chine       | 30 369 067                       | -                                    | 30 369 067                               |
|                              | <b>30 369 067</b>                | <b>-</b>                             | <b>30 369 067</b>                        |

#### SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|                              | USD                              | USD                                  | USD                                      |
| <b>Exposition en devises</b> |                                  |                                      |  |
| Euro                         | 30 448                           | -                                    | 30 448                                   |
|                              | <b>30 448</b>                    | <b>-</b>                             | <b>30 448</b>                            |



## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

#### Risque de change (suite)

31 mars 2022 (suite)

#### SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b> |   |   |   |
| Euro                         | 3 055                                   | -   | 3 055   |
|                              | <b>3 055</b>                            | <b>-</b>                                    | <b>3 055</b>                                    |

#### SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b> |   |   |   |
| Dollar australien            | 111 206                                 | 9 827 922                                   | 9 939 128                                       |
| Réal brésilien               | 27 080                                  | 856 471                                     | 883 551   |
| Livre sterling               | 106 422                                 | 15 992 248                                  | 16 098 670                                      |
| Dollar canadien              | (11 503)                                | 4 415 635                                   | 4 404 132                                       |
| Euro                         | 81 093                                  | 15 284 805                                  | 15 365 898                                      |
| Dollar de Hong Kong          | 127 861                                 | 7 124 826                                   | 7 252 687                                       |
| Nouveau shekel israélien     | 6 505                                   | 673 759                                     | 680 264   |
| Yen japonais                 | 630 247                                 | 31 240 593                                  | 31 870 840                                      |
| Peso mexicain                | 38 843                                  | 754 116                                     | 792 959   |
| Dollar néo-zélandais         | 4 949                                   | -   | 4 949   |
| Couronne norvégienne         | 25 880                                  | 778 256                                     | 804 136   |
| Peso philippin               | 9 531                                   | -   | 9 531   |
| Zloty polonais               | 4 100                                   | -   | 4 100   |
| Riyal saoudien               | 49 626                                  | 117 389                                     | 167 015   |
| Dollar de Singapour          | 119 727                                 | 10 391 870                                  | 10 511 597                                      |
| Rand sud-africain            | 63 237                                  | 1 906 733                                   | 1 969 970                                       |
| Couronne suédoise            | 65 188                                  | 5 433 485                                   | 5 498 673                                       |
| Franc suisse                 | 4 926                                   | 2 867 672                                   | 2 872 598                                       |
| Baht thaïlandais             | 26 393                                  | 514 506                                     | 540 899   |
| Lire turque                  | 474                                     | -   | 474   |
|                              | <b>1 491 785</b>                        | <b>108 180 286</b>                          | <b>109 672 071</b>                              |

#### SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>EUR | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>EUR | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>EUR |
|------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b> |   |   |   |
| Livre sterling               | 1 174                                   | -   | 1 174   |
| Couronne danoise             | 276                                     | -   | 276   |
| Couronne norvégienne         | 5 949                                   | 344 137                                     | 350 086   |
| Couronne suédoise            | 38 549                                  | 14 589 049                                  | 14 627 598                                      |
| Franc suisse                 | 34 027                                  | 6 291 883                                   | 6 325 910                                       |
| Dollar américain             | 584                                     | -   | 584   |
|                              | <b>80 559</b>                           | <b>21 225 069</b>                           | <b>21 305 628</b>                               |

#### SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>GBP | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>GBP | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>GBP |
|------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b> |   |   |   |
| Dollar canadien              | 11 229                                  | -   | 11 229  |
| Euro                         | 226 677                                 | -   | 226 677   |
| Dollar américain             | 1 704 749                               | -   | 1 704 749                                       |
|                              | <b>1 942 655</b>                        | <b>-</b>                                    | <b>1 942 655</b>                                |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

##### Risque de change (suite)

31 mars 2022 (suite)

#### SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

|                                   | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|-----------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|                                   | USD                              | USD                                  | USD                                      |
| <b>Exposition en devises</b>      |                                  |                                      |  |
| Dollar australien                 | (8 376 877)                      | 63 991 348                           | 55 614 471                               |
| Réal brésilien                    | 362 551                          | 18 804 339                           | 19 166 890                               |
| Livre sterling                    | (17 751 750)                     | 121 068 310                          | 103 316 560                              |
| Dollar canadien                   | (15 180 370)                     | 102 830 264                          | 87 649 893                               |
| Peso chilien                      | 53 075                           | 771 925                              | 825 000                                  |
| Yuan Renminbi de Chine            | 2 612                            | 15 162 883                           | 15 165 495                               |
| Peso colombien                    | 5 717                            | 549 352                              | 555 069                                  |
| Couronne tchèque                  | 16 708                           | 767 684                              | 784 392                                  |
| Couronne danoise                  | (2 492 819)                      | 22 088 272                           | 19 595 453                               |
| Livre égyptienne                  | -                                | 226 499                              | 226 499                                  |
| Euro                              | 362 757 218                      | 246 143 295                          | 608 900 513                              |
| Dollar de Hong Kong               | (3 151 424)                      | 100 147 778                          | 96 996 354                               |
| Forint hongrois                   | 23 205                           | 497 706                              | 520 911                                  |
| Roupie indienne                   | 308 712                          | 39 908 225                           | 40 216 937                               |
| Roupie indonésienne               | 101 276                          | 5 813 770                            | 5 915 046                                |
| Nouveau shekel israélien          | (583 713)                        | 2 570 213                            | 1 986 500                                |
| Yen japonais                      | (24 773 839)                     | 175 096 483                          | 150 322 644                              |
| Dinar koweïtien                   | 93 673                           | 2 476 771                            | 2 570 444                                |
| Ringgit malais                    | 114 806                          | 4 609 739                            | 4 724 545                                |
| Peso mexicain                     | 33 234                           | 7 753 309                            | 7 786 543                                |
| Nouveau dollar de<br>Taïwan       | 133 907                          | 56 622 347                           | 56 756 254                               |
| Dollar néo-zélandais              | (63 788)                         | 1 625 592                            | 1 561 804                                |
| Couronne norvégienne              | (615 212)                        | 6 690 875                            | 6 075 663                                |
| Peso philippin                    | 16 622                           | 1 554 427                            | 1 571 049                                |
| Zloty polonais                    | 39 937                           | 1 556 639                            | 1 596 576                                |
| Riyal qatari                      | 62 880                           | 2 438 367                            | 2 501 247                                |
| Riyal saoudien                    | 80 061                           | 13 678 457                           | 13 758 518                               |
| Dollar de Singapour               | (1 349 008)                      | 11 292 280                           | 9 943 272                                |
| Rand sud-africain                 | 174 264                          | 12 528 210                           | 12 702 474                               |
| Won sud-coréen                    | 529 189                          | 42 280 924                           | 42 810 113                               |
| Couronne suédoise                 | (4 004 457)                      | 27 563 034                           | 23 558 577                               |
| Franc suisse                      | (11 977 164)                     | 82 595 244                           | 70 618 080                               |
| Baht thaïlandais                  | 81 326                           | 5 116 386                            | 5 197 712                                |
| Lire turque                       | 38 002                           | 545 616                              | 583 618                                  |
| Dirham des Émirats<br>arabes unis | 57 549                           | 2 775 634                            | 2 833 183                                |
|                                   | <b>274 766 1031 200 142 196</b>  | <b>1 474 908 299</b>                 |  |

#### SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|                              | USD                              | USD                                  | USD                                      |
| <b>Exposition en devises</b> |                                  |                                      |  |
| Yuan renminbi de<br>Chine    | (859)                            | 73 570 031                           | 73 569 172                               |
| Euro                         | 157 741                          | -                                    | 157 741                                  |
| Dollar de Hong Kong          | 222                              | 320 116 193                          | 320 116 415                              |
| Roupie indienne              | 484 417                          | 191 038 672                          | 191 523 089                              |
| Roupie indonésienne          | 321 203                          | 22 488 990                           | 22 810 193                               |
| Ringgit malais               | 326 731                          | 21 820 357                           | 22 147 088                               |
| Nouveau dollar de<br>Taïwan  | 479 994                          | 231 168 793                          | 231 648 787                              |
| Roupie pakistanaise          | 859                              | -                                    | 859                                      |
| Peso philippin               | 78 143                           | 11 622 226                           | 11 700 369                               |
| Won sud-coréen               | 2 323 489                        | 166 406 792                          | 168 730 281                              |
| Baht thaïlandais             | 237 185                          | 27 130 774                           | 27 367 959                               |
|                              | <b>4 409 125 1 065 362 828</b>   | <b>1 069 771 953</b>                 |  |

#### SPDR MSCI EMU UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|                              | EUR                              | EUR                                  | EUR                                      |
| <b>Exposition en devises</b> |                                  |                                      |  |
| Livre sterling               | 5                                | -                                    | 5  |
| Dollar américain             | 37 924                           | 713 288                              | 751 212                                  |
|                              | <b>37 929</b>                    | <b>713 288</b>                       | <b>751 217</b>                           |

#### SPDR MSCI Japan UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--|
|                              | JPY                              | JPY                                  | JPY                                      |
| <b>Exposition en devises</b> |                                  |                                      |  |
| Euro                         | 1 663 971 940                    | -1 663 971 940                       |  |
|                              | <b>1 663 971 940</b>             | <b>-1 663 971 940</b>                |  |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

#### Risque de change (suite)

31 mars 2022 (suite)

#### SPDR MSCI World UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b> |   |   |   |
| <b>Dollar australien</b>     | 595 077                                 | 32 297 764                                  | 32 892 841                                      |
| Livre sterling               | 670 166                                 | 60 562 604                                  | 61 232 770                                      |
| Dollar canadien              | 395 103                                 | 51 402 269                                  | 51 797 372                                      |
| Couronne danoise             | 228 052                                 | 10 828 724                                  | 11 056 776                                      |
| Euro                         | 557 176                                 | 123 935 804                                 | 124 492 980                                     |
| Dollar de Hong Kong          | 123 768                                 | 11 140 726                                  | 11 264 494                                      |
| Nouveau shekel israélien     | 54 962                                  | 1 454 767                                   | 1 509 729                                       |
| Yen japonais                 | 1 428 928                               | 87 608 596                                  | 89 037 524                                      |
| Dollar néo-zélandais         | 83 925                                  | 771 580                                     | 855 505   |
| Couronne norvégienne         | 115 907                                 | 3 044 805                                   | 3 160 712                                       |
| Dollar de Singapour          | 166 998                                 | 4 732 254                                   | 4 899 252                                       |
| Couronne suédoise            | 293 915                                 | 13 902 463                                  | 14 196 378                                      |
| Franc suisse                 | 330 841                                 | 41 486 701                                  | 41 817 542                                      |
|                              | <b>5 044 817</b>                        | <b>443 169 057</b>                          | <b>448 213 874</b>                              |

#### SPDR S&P 500 UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b> |   |   |   |
| <b>Euro</b>                  | 437 062 353                             | -   | 437 062 353                                     |
|                              | <b>437 062 353</b>                      | <b>-</b>                                    | <b>437 062 353</b>                              |

#### SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF

|                                | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|--------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b>   |   |   |   |
| <b>Réal brésilien</b>          | 27 631                                  | 4 131 350                                   | 4 158 981                                       |
| Livre sterling                 | 4 243                                   | -   | 4 243   |
| Peso colombien                 | 163                                     | -   | 163   |
| Couronne tchèque               | 781                                     | -   | 781   |
| Livre égyptienne               | 10                                      | -   | 10  |
| Euro                           | 2 860                                   | 1 280 698                                   | 1 283 558                                       |
| Dollar de Hong Kong            | 24 980                                  | 41 919 401                                  | 41 944 381                                      |
| Forint hongrois                | 10                                      | -   | 10  |
| Roupie indienne                | 2 367                                   | -   | 2 367   |
| Roupie indonésienne            | 26 430                                  | -   | 26 430  |
| Dinar koweïtien                | 2 696                                   | -   | 2 696   |
| Ringgit malais                 | 20 978                                  | 482 991                                     | 503 969   |
| Peso mexicain                  | 10 427                                  | 3 150 063                                   | 3 160 490                                       |
| Dirham marocain                | 4                                       | -   | 4   |
| Nouveau dollar de Taiwan       | 113 377                                 | 12 396 082                                  | 12 509 459                                      |
| Peso philippin                 | 8 058                                   | 618 740                                     | 626 798   |
| Zloty polonais                 | 4 309                                   | -   | 4 309   |
| Riyal qatari                   | 6 956                                   | -   | 6 956   |
| Riyal saoudien                 | 16 643                                  | 4 087 013                                   | 4 103 656                                       |
| Dollar de Singapour            | 248                                     | -   | 248   |
| Rand sud-africain              | 20 605                                  | -   | 20 605  |
| Won sud-coréen                 | 645 847                                 | 25 380 727                                  | 26 026 574                                      |
| Baht thaïlandais               | 49 511                                  | 1 184 497                                   | 1 234 008                                       |
| Lire turque                    | 2 293                                   | 511 793                                     | 514 086   |
| Dirham des Émirats arabes unis | 24 870                                  | 6 119 371                                   | 6 144 241                                       |
|                                | <b>1 016 297</b>                        | <b>101 262 726</b>                          | <b>102 279 023</b>                              |

#### SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>EUR | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>EUR | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>EUR |
|------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b> |   |   |   |
| <b>Livre sterling</b>        | 25 154                                  | -   | 25 154  |
| Dollar américain             | 603 170                                 | -   | 603 170   |
|                              | <b>628 324</b>                          | <b>-</b>                                    | <b>628 324</b>                                  |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

#### Risque de change (suite)

31 mars 2022 (suite)

#### SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF

|                                | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|--------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b>   |   |   |   |
| Dollar australien              | 216                                     | -   | 216   |
| Livre sterling                 | 459 641                                 | 74 844 721                                  | 75 304 362                                      |
| Dollar canadien                | 917 268                                 | 114 070 007                                 | 114 987 275                                     |
| Couronne danoise               | 9 670                                   | -   | 9 670   |
| Euro                           | 1 025 318                               | 105 179 078                                 | 106 204 396                                     |
| Dollar de Hong Kong            | 269 770                                 | 90 220 001                                  | 90 489 771                                      |
| Yen japonais                   | 2 582 377                               | 105 172 292                                 | 107 754 669                                     |
| Peso mexicain                  | 836                                     | 12 031 910                                  | 12 032 746                                      |
| Couronne norvégienne           | 1 960                                   | 14 433 523                                  | 14 435 483                                      |
| Dollar de Singapour            | 14 398                                  | 11 093 773                                  | 11 108 171                                      |
| Rand sud-africain              | 2 050                                   | -   | 2 050   |
| Won sud-coréen                 | 611 610                                 | 15 480 648                                  | 16 092 258                                      |
| Couronne suédoise              | 15 840                                  | 12 573 344                                  | 12 589 184                                      |
| Franc suisse                   | 56 191                                  | 69 964 472                                  | 70 020 663                                      |
| Baht thaïlandais               | 12                                      | -   | 12  |
| Dirham des Émirats arabes unis | 37 189                                  | -   | 37 189  |
|                                | <b>6 004 346</b>                        | <b>625 063 769</b>                          | <b>631 068 115</b>                              |

#### SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>USD | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>USD |
|------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b> |   |   |   |
| Dollar australien            | 414 865                                 | 28 049 296                                  | 28 464 161                                      |
| Dollar de Hong Kong          | 377 286                                 | 68 663 097                                  | 69 040 383                                      |
| Roupie indienne              | 4 794                                   | 1 222 145                                   | 1 226 939                                       |
| Roupie indonésienne          | 29 637                                  | 1 137 905                                   | 1 167 542                                       |
| Yen japonais                 | 730 289                                 | 45 330 623                                  | 46 060 912                                      |
| Ringgit malais               | 954                                     | -   | 954   |
| Nouveau dollar de Taïwan     | 19 502                                  | 8 220 604                                   | 8 240 106                                       |
| Dollar néo-zélandais         | 726                                     | 926 672                                     | 927 398   |
| Peso philippin               | 80 256                                  | 1 332 248                                   | 1 412 504                                       |
| Dollar de Singapour          | 2 478                                   | -   | 2 478   |
| Won sud-coréen               | 1 168                                   | -   | 1 168   |
| Baht thaïlandais             | 3 440                                   | 1 085 317                                   | 1 088 757                                       |
|                              | <b>1 665 395</b>                        | <b>155 967 907</b>                          | <b>157 633 302</b>                              |

#### SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires<br>GBP | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires<br>GBP | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets<br>GBP |
|------------------------------|---|---|---|
| <b>Exposition en devises</b> |   |   |   |
| Dollar américain             | 54 036                                  | -   | 54 036  |
|                              | <b>54 036</b>                           | <b>-</b>                                    | <b>54 036</b>                                   |

#### SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF

|                              | Actifs/<br>Passifs<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs non<br>monétaires | Actifs/<br>Passifs<br>financiers<br>nets |
|------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|--|
| <b>Exposition en devises</b> |                                  |                                      |  |
| Euro                         | 119 156 923                      | -                                    | 119 156 923                              |
|                              | <b>119 156 923</b>               | <b>-</b>                             | <b>119 156 923</b>                       |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

##### Risque de change (suite)

Les tableaux ci-dessous décrivent l'augmentation ou la diminution approximative des actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables pour chaque Compartiment en cas d'augmentation ou de diminution de 5 % (sur la base des éléments monétaires) du taux de change entre la devise fonctionnelle et la devise concernée au 31 mars 2023.

#### 31 mars 2023

|                                       | SPDR Bloomberg<br>0-3 Year<br>U.S. Corporate<br>Bond UCITS ETF | SPDR Bloomberg<br>1-3 Month T-Bill<br>UCITS ETF | SPDR Bloomberg<br>1-3 Year<br>U.S. Treasury<br>Bond UCITS ETF | SPDR Bloomberg<br>1-10 Year<br>U.S. Corporate<br>Bond UCITS ETF | SPDR Bloomberg<br>Emerging Markets<br>Local Bond UCITS<br>ETF | SPDR Bloomberg<br>Global Aggregate<br>Bond UCITS ETF |
|---------------------------------------|--|---|---|---|---|--|
|                                       | USD  | USD   | USD   | USD   | USD   | USD  |
| Augmentation/<br>Diminution de<br>5 % | 1  | 637 816   | 44  | 8   | 139 901 443   | 75 267 102   |

|                                       | SPDR Bloomberg<br>U.S. TIPS UCITS<br>ETF | SPDR Bloomberg<br>U.S. Treasury<br>Bond UCITS ETF | SPDR Bloomberg<br>China Treasury<br>Bond UCITS ETF | SPDR Bloomberg<br>SASB<br>U.S. Corporate<br>ESG UCITS ETF | SPDR Bloomberg<br>SASB U.S. High<br>Yield Corporate<br>ESG UCITS ETF | SPDR Dow Jones<br>Global Real Estate<br>UCITS ETF |
|---------------------------------------|--|---|--|---|--|---|
|                                       | USD                                      | USD   | USD  | USD   | USD  | USD   |
| Augmentation/<br>Diminution de<br>5 % | 166                                      | 30  | 991 610  | 13 854 089  | 2 658 062  | 31 335  |

|                                       | SPDR FTSE EPRA<br>Europe Ex UK Real<br>Estate UCITS ETF | SPDR FTSE U.K.<br>All Share UCITS<br>ETF | SPDR MSCI ACWI<br>UCITS ETF | SPDR MSCI EM<br>Asia UCITS ETF | SPDR MSCI EMU<br>UCITS ETF | SPDR MSCI Japan<br>UCITS ETF |
|---------------------------------------|---|--|-----------------------------|--------------------------------|----------------------------|------------------------------|
|                                       | EUR   | GBP                                      | USD                         | USD                            | EUR                        | JPY                          |
| Augmentation/<br>Diminution de<br>5 % | 5 423   | 106 467                                  | 11 104 260                  | 230 063                        | 4 566                      | 124 946 480                  |

|                                       | SPDR MSCI World<br>UCITS ETF | SPDR S&P 400<br>U.S. Mid Cap<br>UCITS ETF | SPDR S&P 500<br>ESG Leaders<br>UCITS ETF* | SPDR S&P 500<br>UCITS ETF | SPDR S&P 500<br>Low Volatility<br>UCITS ETF |
|---------------------------------------|------------------------------|---|---|---------------------------|---|
|                                       | USD                          | USD                                       | USD                                       | USD                       | USD   |
| Augmentation/<br>Diminution de<br>5 % | 304 544                      | 23  | 82  | 22 499 047                | 155   |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

#### Risque de change (suite)

#### 31 mars 2023 (suite)

|                                       | SPDR S&P<br>Emerging Markets<br>Dividend<br>Aristocrats UCITS<br>ETF | SPDR S&P Euro<br>Dividend<br>Aristocrats UCITS<br>ETF | SPDR S&P Global<br>Dividend<br>Aristocrats UCITS<br>ETF | SPDR S&P Pan<br>Asia Dividend<br>Aristocrats UCITS<br>ETF | SPDR S&P U.K.<br>Dividend<br>Aristocrats UCITS<br>ETF | SPDR S&P<br>U.S. Dividend<br>Aristocrats UCITS<br>ETF |
|---------------------------------------|--|---|---|---|---|---|
|                                       | USD  | EUR   | USD   | USD   | GBP   | USD   |
| Augmentation/<br>Diminution de<br>5 % | 76 302   | 41 232  | 123 608   | 80 306  | 4 488   | 10 604 849  |

\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

#### 31 mars 2022

|                                       | SPDR Bloomberg<br>1-3 Month T-Bill<br>UCITS ETF | SPDR Bloomberg<br>Emerging Markets<br>Local Bond UCITS<br>ETF | SPDR Bloomberg<br>Global Aggregate<br>Bond UCITS ETF | SPDR Bloomberg<br>U.S. Treasury<br>Bond UCITS ETF | SPDR Bloomberg<br>China Treasury<br>Bond UCITS ETF | SPDR Bloomberg<br>SASB<br>U.S. Corporate<br>ESG UCITS ETF |
|---------------------------------------|---|---|--|---|--|---|
|                                       | USD   | USD   | USD  | USD   | USD  | USD   |
| Augmentation/<br>Diminution de<br>5 % | 627 341   | 166 100 473   | 34 093 545   | 6   | 2 018 453  | 1 522   |

|                                       | SPDR Dow Jones<br>Global Real Estate<br>UCITS ETF | SPDR FTSE EPRA<br>Europe Ex UK Real<br>Estate UCITS ETF | SPDR FTSE U.K.<br>All Share UCITS<br>ETF | SPDR MSCI ACWI<br>UCITS ETF | SPDR MSCI EM<br>Asia UCITS ETF |
|---------------------------------------|---|---|--|-----------------------------|--------------------------------|
|                                       | USD   | EUR   | GBP                                      | USD                         | USD                            |
| Augmentation/<br>Diminution de<br>5 % | 74 589  | 4 028   | 97 133                                   | 13 738 305                  | 220 456                        |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

#### Risque de change (suite)

#### 31 mars 2022 (suite)

|                                       | SPDR MSCI EMU<br>UCITS ETF | SPDR MSCI Japan<br>UCITS ETF | SPDR MSCI World<br>UCITS ETF | SPDR S&P 500<br>UCITS ETF | SPDR S&P<br>Emerging<br>Markets<br>Dividend<br>Aristocrats<br>UCITS<br>ETF | SPDR S&P Euro<br>Dividend<br>Aristocrats UCITS<br>ETF |
|---------------------------------------|----------------------------|------------------------------|------------------------------|---------------------------|--|---|
|                                       | EUR                        | JPY                          | USD                          | USD                       | USD  | EUR   |
| Augmentation/<br>Diminution de<br>5 % | 1 896                      | 83 198 597                   | 22 410 694                   | 21 853 118                | 50 815   | 31 416  |

|                                       | SPDR S&P Global<br>Dividend<br>Aristocrats UCITS<br>ETF | SPDR S&P Pan<br>Asia Dividend<br>Aristocrats UCITS<br>ETF | SPDR S&P U.K.<br>Dividend<br>Aristocrats UCITS<br>ETF | SPDR S&P<br>U.S. Dividend<br>Aristocrats UCITS<br>ETF |
|---------------------------------------|---|---|---|---|
|                                       | USD   | USD   | GBP   | USD   |
| Augmentation/<br>Diminution de<br>5 % | 31 553 406  | 83 270  | 2 702   | 5 957 846   |

Au 31 mars 2023 et au 31 mars 2022, excepté pour les Compartiments susvisés, aucun autre Compartiment n'avait une exposition aux devises autres que sa devise fonctionnelle.

#### Risque de taux d'intérêt

Le risque de taux d'intérêt est lié aux conséquences des fluctuations des niveaux actuels des taux d'intérêt du marché sur la juste valeur des actifs et des passifs financiers et sur les flux de trésorerie ultérieurs. Les Compartiments analysés ci-dessous détiennent des titres à intérêt fixe qui les exposent au risque de variations de la juste valeur découlant des fluctuations des taux d'intérêt.

Avec une hausse des taux d'intérêt, les valeurs des titres de créance ou d'autres investissements produisant des revenus seront vraisemblablement réduites. Ce risque est généralement plus élevé pour les obligations présentant des échéances plus longues.

Les avoirs liquides et découverts des Compartiments ne sont pas soumis à un risque de taux d'intérêt significatif.

L'exposition de chaque Compartiment aux fluctuations des taux d'intérêt est présentée dans le tableau suivant et classée selon sa date d'échéance.

#### 31 mars 2023

#### SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

|                                      | Jusqu'à<br>1 an<br>EUR | De 1-5 ans<br>EUR  | Plus de<br>5 ans<br>EUR | Ne portant<br>pas intérêt<br>EUR | Total<br>EUR         |
|--------------------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------|----------------------------------|----------------------|
| Trésorerie et<br>soldes<br>bancaires | 53 546 295             | -                  | -                       | -                                | 53 546 295           |
| Valeurs<br>mobilières                | 450 532 055            | 180 137 339        | 139 645 260             | -                                | 1 770 314 654        |
| Autres actifs                        | -                      | -                  | -                       | 38 137 114                       | 38 137 114           |
| <b>Total des actifs</b>              | <b>504 078 350</b>     | <b>180 137 339</b> | <b>139 645 260</b>      | <b>38 137 114</b>                | <b>1 861 998 063</b> |
| Autres passifs                       | -                      | -                  | -                       | (75 765 199)                     | (75 765 199)         |
| <b>Total des<br/>passifs</b>         | <b>-</b>               | <b>-</b>           | <b>-</b>                | <b>(75 765 199)</b>              | <b>(75 765 199)</b>  |
| <b>Total des actifs<br/>nets</b>     |                        |                    |                         |                                  | <b>1 786 232 864</b> |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

#### Risque de taux d'intérêt (suite)

31 mars 2023 (suite)

#### SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à<br>1 an       | De 1-5 ans     | Plus de<br>5 ans | Ne<br>portant<br>pas<br>intérêt | Total              |
|--------------------------------|-----------------------|----------------|------------------|---------------------------------|--------------------|
|                                | USD                   | USD            | USD              | USD                             | USD                |
| Trésorerie et soldes bancaires | 170 316               | -              | -                | -                               | 170 316            |
| Valeurs mobilières             | 37 407 190 141        | 146 463        | 1 495 758        | -                               | 180 049 411        |
| Autres actifs                  | -                     | -              | -                | 1 500 632                       | 1 500 632          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>37 577 506 141</b> | <b>146 463</b> | <b>1 495 758</b> | <b>1 500 632</b>                | <b>181 720 359</b> |
| Autres passifs                 | -                     | -              | -                | (18 799)                        | (18 799)           |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>              | <b>-</b>       | <b>-</b>         | <b>(18 799)</b>                 | <b>(18 799)</b>    |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                       |                |                  |                                 | <b>181 701 560</b> |

#### SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF

|                                | Jusqu'à 1 an       | De 1-5 ans | Plus de 5 ans | Ne portant pas intérêt | Total                |
|--------------------------------|--------------------|------------|---------------|------------------------|----------------------|
|                                | USD                | USD        | USD           | USD                    | USD                  |
| Trésorerie et soldes bancaires | 6 167 389          | -          | -             | -                      | 6 167 389            |
| Valeurs mobilières             | 275 310 071        | -          | -             | -                      | 275 310 071          |
| Instruments financiers dérivés | -                  | -          | -             | 319 957                | 319 957              |
| Autres actifs                  | -                  | -          | -             | 135 086 259            | 135 086 259          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>281 477 460</b> | <b>-</b>   | <b>-</b>      | <b>135 406 216</b>     | <b>416 883 676</b>   |
| Instruments financiers dérivés | -                  | -          | -             | (26 737)               | (26 737)             |
| Autres passifs                 | -                  | -          | -             | (156 763 760)          | (156 763 760)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>           | <b>-</b>   | <b>-</b>      | <b>(156 790 497)</b>   | <b>(156 790 497)</b> |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                    |            |               |                        | <b>260 093 179</b>   |

#### SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à<br>1 an  | De 1-5 ans         | Plus de<br>5 ans | Ne portant<br>pas intérêt | Total               |
|--------------------------------|------------------|--------------------|------------------|---------------------------|---------------------|
|                                | EUR              | EUR                | EUR              | EUR                       | EUR                 |
| Trésorerie et soldes bancaires | 2 718 418        | -                  | -                | -                         | 2 718 418           |
| Valeurs mobilières             | -                | 620 270 852        | -                | -                         | 620 270 852         |
| Autres actifs                  | -                | -                  | -                | 40 912 973                | 40 912 973          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>2 718 418</b> | <b>620 270 852</b> | <b>-</b>         | <b>40 912 973</b>         | <b>663 902 243</b>  |
| Autres passifs                 | -                | -                  | -                | (37 090 292)              | (37 090 292)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>         | <b>-</b>           | <b>-</b>         | <b>(37 090 292)</b>       | <b>(37 090 292)</b> |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                  |                    |                  |                           | <b>626 811 951</b>  |

#### SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à<br>1 an | De 1-5 ans        | Plus de<br>5 ans | Ne portant<br>pas intérêt | Total              |
|--------------------------------|-----------------|-------------------|------------------|---------------------------|--------------------|
|                                | USD             | USD               | USD              | USD                       | USD                |
| Trésorerie et soldes bancaires | 171 855         | -                 | -                | -                         | 171 855            |
| Valeurs mobilières             | -               | 94 418 076        | -                | -                         | 94 418 076         |
| Autres actifs                  | -               | -                 | -                | 4 990 089                 | 4 990 089          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>171 855</b>  | <b>94 418 076</b> | <b>-</b>         | <b>4 990 089</b>          | <b>99 580 020</b>  |
| Autres passifs                 | -               | -                 | -                | (4 580 256)               | (4 580 256)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>        | <b>-</b>          | <b>-</b>         | <b>(4 580 256)</b>        | <b>(4 580 256)</b> |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                 |                   |                  |                           | <b>94 999 764</b>  |



## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

#### Risque de taux d'intérêt (suite)

31 mars 2023 (suite)

#### SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à<br>1 an  | De 1-5 ans        | Plus de<br>5 ans  | Ne portant<br>pas intérêt | Total              |
|--------------------------------|------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|--------------------|
|                                | USD              | USD               | USD               | USD                       | USD                |
| Trésorerie et soldes bancaires | 1 115 843        | -                 | -                 | -                         | 1 115 843          |
| Valeurs mobilières             | - 88 318 642     | 71 049 941        | -                 | -                         | 159 368 583        |
| Autres actifs                  | -                | -                 | -                 | 4 147 100                 | 4 147 100          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>1 115 843</b> | <b>88 318 642</b> | <b>71 049 941</b> | <b>4 147 100</b>          | <b>164 631 526</b> |
| Autres passifs                 | -                | -                 | -                 | (3 558 068)               | (3 558 068)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>         | <b>-</b>          | <b>-</b>          | <b>(3 558 068)</b>        | <b>(3 558 068)</b> |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                  |                   |                   |                           | <b>161 073 458</b> |

#### SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à 1 an       | De 1-5 ans           | Plus de 5 ans        | Ne portant pas intérêt | Total                |
|--------------------------------|--------------------|----------------------|----------------------|------------------------|----------------------|
|                                | USD                | USD                  | USD                  | USD                    | USD                  |
| Trésorerie et soldes bancaires | 27 599 459         | -                    | -                    | -                      | 27 599 459           |
| Valeurs mobilières             | 47 639 781         | 1 046 429 788        | 1 458 870 836        | -                      | 2 552 940 405        |
| Autres actifs                  | -                  | -                    | -                    | 6 323 103              | 6 323 103            |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>75 239 240</b>  | <b>1 046 429 788</b> | <b>1 458 870 836</b> | <b>73 632 411</b>      | <b>2 654 172 275</b> |
| Découverts bancaires           | (3 090 446)        | -                    | -                    | -                      | (3 090 446)          |
| Autres passifs                 | -                  | -                    | -                    | (1 086 087)            | (1 086 087)          |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>(3 090 446)</b> | <b>-</b>             | <b>(1 086 087)</b>   | <b>(39 161 636)</b>    | <b>(43 338 169)</b>  |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                    |                      |                      |                        | <b>2 610 834 106</b> |

#### SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à 1 an   | De 1-5 ans         | Plus de 5 ans      | Ne portant pas intérêt | Total              |
|--------------------------------|----------------|--------------------|--------------------|------------------------|--------------------|
|                                | EUR            | EUR                | EUR                | EUR                    | EUR                |
| Trésorerie et soldes bancaires | 591 178        | -                  | -                  | -                      | 591 178            |
| Valeurs mobilières             | -              | 213 319 471        | 253 659 743        | -                      | 466 979 214        |
| Autres actifs                  | -              | -                  | -                  | 9 187 328              | 9 187 328          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>591 178</b> | <b>213 319 471</b> | <b>253 659 743</b> | <b>9 187 328</b>       | <b>476 757 720</b> |
| Autres passifs                 | -              | -                  | -                  | (5 083 435)            | (5 083 435)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>       | <b>-</b>           | <b>-</b>           | <b>(5 083 435)</b>     | <b>(5 083 435)</b> |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                |                    |                    |                        | <b>471 674 285</b> |

#### SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à 1 an     | De 1-5 ans         | Plus de 5 ans      | Ne portant pas intérêt | Total                |
|--------------------------------|------------------|--------------------|--------------------|------------------------|----------------------|
|                                | EUR              | EUR                | EUR                | EUR                    | EUR                  |
| Trésorerie et soldes bancaires | 3 536 910        | -                  | -                  | -                      | 3 536 910            |
| Valeurs mobilières             | - 418 704 837    | 610 697 430        | -                  | -                      | 191 992 593          |
| Autres actifs                  | -                | -                  | -                  | 26 518 733             | 26 518 733           |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>3 536 910</b> | <b>418 704 837</b> | <b>610 697 430</b> | <b>26 518 733</b>      | <b>1 059 457 910</b> |
| Autres passifs                 | -                | -                  | -                  | (20 172 356)           | (20 172 356)         |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>         | <b>-</b>           | <b>-</b>           | <b>(20 172 356)</b>    | <b>(20 172 356)</b>  |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                  |                    |                    |                        | <b>1 039 285 554</b> |

#### SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à 1 an     | De 1-5 ans         | Plus de 5 ans     | Ne portant pas intérêt | Total               |
|--------------------------------|------------------|--------------------|-------------------|------------------------|---------------------|
|                                | EUR              | EUR                | EUR               | EUR                    | EUR                 |
| Trésorerie et soldes bancaires | 2 286 034        | -                  | -                 | -                      | 2 286 034           |
| Valeurs mobilières             | - 324 024 592    | 99 768 114         | -                 | -                      | 195 743 522         |
| Autres actifs                  | -                | -                  | -                 | 20 568 850             | 20 568 850          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>2 286 034</b> | <b>324 024 592</b> | <b>99 768 114</b> | <b>20 568 850</b>      | <b>446 647 590</b>  |
| Autres passifs                 | -                | -                  | -                 | (13 345 638)           | (13 345 638)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>         | <b>-</b>           | <b>-</b>          | <b>(13 345 638)</b>    | <b>(13 345 638)</b> |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                  |                    |                   |                        | <b>433 301 952</b>  |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

#### Risque de taux d'intérêt (suite)

31 mars 2023 (suite)

#### SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à 1 an      | De 1-5 ans         | Plus de 5 ans          | Ne portant pas intérêt | Total                |
|--------------------------------|-------------------|--------------------|------------------------|------------------------|----------------------|
|                                | USD               | USD                | USD                    | USD                    | USD                  |
| Trésorerie et soldes bancaires | 41 378 838        | -                  | -                      | -                      | 41 378 838           |
| Valeurs mobilières             | 31 143 020        | 1 016 434 6        | 841 552 425 719        | -                      | 2 600 003 423        |
| Instruments financiers dérivés | -                 | -                  | -                      | 58 745 923             | 58 745 923           |
| Autres actifs                  | -                 | -                  | -                      | 38 972 871             | 38 972 871           |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>72 521 858</b> | <b>1 016 434 6</b> | <b>841 552 425 719</b> | <b>97 718 794 2739</b> | <b>101 055</b>       |
| Découverts bancaires           | (384 790)         | -                  | -                      | -                      | (384 790)            |
| Instruments financiers dérivés | -                 | -                  | -                      | (15 971 218)           | (15 971 218)         |
| Autres passifs                 | -                 | -                  | -                      | (60 352 246)           | (60 352 246)         |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>(384 790)</b>  | <b>-</b>           | <b>(76 323 466)</b>    | <b>(76 708 256)</b>    |                      |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                   |                    |                        |                        | <b>2 662 392 801</b> |

#### SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF

|                                | Jusqu'à 1 an   | De 1-5 ans         | Plus de 5 ans      | Ne portant pas intérêt | Total              |
|--------------------------------|----------------|--------------------|--------------------|------------------------|--------------------|
|                                | USD            | USD                | USD                | USD                    | USD                |
| Trésorerie et soldes bancaires | 807 339        | -                  | -                  | -                      | 807 339            |
| Valeurs mobilières             | -              | 173 575 219        | 180 650 910        | -                      | 354 226 129        |
| Autres actifs                  | -              | -                  | -                  | 3 092 744              | 3 092 744          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>807 339</b> | <b>173 575 219</b> | <b>180 650 910</b> | <b>3 092 744</b>       | <b>358 126 212</b> |
|                                |                |                    |                    | (2 762 065)            |                    |
| Autres passifs                 | -              | -                  | -                  | -                      | (2 762 065)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>       | <b>-</b>           | <b>-</b>           | <b>(2 762 065)</b>     |                    |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                |                    |                    |                        | <b>355 364 147</b> |

#### SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à 1 an     | De 1-5 ans         | Plus de 5 ans      | Ne portant pas intérêt | Total              |
|--------------------------------|------------------|--------------------|--------------------|------------------------|--------------------|
|                                | USD              | USD                | USD                | USD                    | USD                |
| Trésorerie et soldes bancaires | 1 526 406        | -                  | -                  | -                      | 1 526 406          |
| Valeurs mobilières             | -                | 262 812 777        | 222 806 745        | -                      | 485 619 522        |
| Autres actifs                  | -                | -                  | -                  | 8 769 108              | 8 769 108          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>1 526 517</b> | <b>262 812 777</b> | <b>222 806 745</b> | <b>8 769 108</b>       | <b>495 915 147</b> |
| Autres passifs                 | -                | -                  | -                  | (7 024 608)            | (7 024 608)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>         | <b>-</b>           | <b>-</b>           | <b>(7 024 608)</b>     |                    |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                  |                    |                    |                        | <b>488 890 539</b> |

#### SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à 1 an   | De 1-5 ans       | Plus de 5 ans    | Ne portant pas intérêt | Total             |
|--------------------------------|----------------|------------------|------------------|------------------------|-------------------|
|                                | USD            | USD              | USD              | USD                    | USD               |
| Trésorerie et soldes bancaires | 86 835         | -                | -                | -                      | 86 835            |
| Valeurs mobilières             | -              | 9 749 764        | 9 800 308        | -                      | 19 550 072        |
| Autres actifs                  | -              | -                | -                | 544 102                | 544 102           |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>86 835</b>  | <b>9 749 764</b> | <b>9 800 308</b> | <b>544 102</b>         | <b>20 181 009</b> |
| Découverts bancaires           | (4 679)        | -                | -                | -                      | (4 679)           |
| Autres passifs                 | -              | -                | -                | (336 667)              | (336 667)         |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>(4 679)</b> | <b>-</b>         | <b>-</b>         | <b>(336 667)</b>       | <b>(341 346)</b>  |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                |                  |                  |                        | <b>19 839 663</b> |

#### SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF

|                                | Jusqu'à 1 an   | De 1-5 ans        | Plus de 5 ans     | Ne portant pas intérêt | Total              |
|--------------------------------|----------------|-------------------|-------------------|------------------------|--------------------|
|                                | EUR            | EUR               | EUR               | EUR                    | EUR                |
| Trésorerie et soldes bancaires | 147 997        | -                 | -                 | -                      | 147 997            |
| Valeurs mobilières             | -              | 35 491 907        | 36 836 389        | -                      | 72 328 296         |
| Autres actifs                  | -              | -                 | -                 | 2 039 360              | 2 039 360          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>147 997</b> | <b>35 491 907</b> | <b>36 836 389</b> | <b>2 039 360</b>       | <b>74 515 653</b>  |
| Autres passifs                 | -              | -                 | -                 | (1 390 602)            | (1 390 602)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>       | <b>-</b>          | <b>-</b>          | <b>(1 390 602)</b>     | <b>(1 390 602)</b> |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                |                   |                   |                        | <b>73 125 051</b>  |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

#### Risque de taux d'intérêt (suite)

31 mars 2023 (suite)

#### SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

|                                | Jusqu'à<br>1 an  | De 1-5 ans           | Plus de<br>5 ans     | Ne portant<br>pas intérêt | Total                |
|--------------------------------|------------------|----------------------|----------------------|---------------------------|----------------------|
|                                | USD              | USD                  | USD                  | USD                       | USD                  |
| Trésorerie et soldes bancaires | 21 450 005       | -                    | -                    | -                         | 21 450 005           |
| Valeurs mobilières             | 334 492 242      | 8 068 192            | 4 311 240            | 171                       | - 6 739 642          |
| Instruments financiers dérivés | -                | -                    | -                    | 8 381 976                 | 8 381 976            |
| Autres actifs                  | -                | -                    | -                    | 199 350 221               | 199 350 221          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>21 784 49</b> | <b>7 242 806</b>     | <b>192 431 124</b>   | <b>171 207 732</b>        | <b>197 696 825</b>   |
| Instruments financiers dérivés | -                | -                    | -                    | (745 982)                 | (745 982)            |
| Autres passifs                 | -                | -                    | -                    | -                         | (131 670 292)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>         | <b>(130 924 310)</b> | <b>(130 924 310)</b> | <b>(131 670 292)</b>      | <b>(131 670 292)</b> |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                  |                      |                      |                           | <b>6 837 154 765</b> |

#### SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

|                                | Jusqu'à 1 an     | De 1-5 ans        | Plus de 5 ans     | Ne portant pas intérêt | Total              |
|--------------------------------|------------------|-------------------|-------------------|------------------------|--------------------|
|                                | USD              | USD               | USD               | USD                    | USD                |
| Trésorerie et soldes bancaires | 693 245          | -                 | -                 | -                      | 693 245            |
| Valeurs mobilières             | 1 046 723        | 93 533 036        | 93 831 902        | -                      | 188 411 661        |
| Instruments financiers dérivés | -                | -                 | -                 | 1 636 126              | 1 636 126          |
| Autres actifs                  | -                | -                 | -                 | 3 155 133              | 3 155 133          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>1 739 968</b> | <b>93 533 036</b> | <b>93 831 902</b> | <b>4 791 259</b>       | <b>193 896 165</b> |
| Instruments financiers dérivés | -                | -                 | -                 | (246 938)              | (246 938)          |
| Autres passifs                 | -                | -                 | -                 | (248 683)              | (248 683)          |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>         | <b>-</b>          | <b>-</b>          | <b>(495 621)</b>       | <b>(495 621)</b>   |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                  |                   |                   |                        | <b>193 400 544</b> |

Au 31 mars 2023, les Compartiments restants détiennent des actifs et des passifs financiers qui ne sont pas exposés au risque de taux d'intérêt. Les Compartiments ont également une exposition indirecte au risque de taux d'intérêt du fait des investissements dans les contrats à terme standardisés, dans la mesure où la valeur de l'actif sous-jacent peut fluctuer en raison de variations des taux d'intérêt.

31 mars 2022

#### SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à<br>1 an    | De 1-5 ans           | Plus de<br>5 ans   | Ne portant<br>pas intérêt | Total                |
|--------------------------------|--------------------|----------------------|--------------------|---------------------------|----------------------|
|                                | EUR                | EUR                  | EUR                | EUR                       | EUR                  |
| Trésorerie et soldes bancaires | 4 791 610          | -                    | -                  | -                         | 4 791 610            |
| Valeurs mobilières             | 400 640 296        | 1 200 024 402        | 132 859 273        | -                         | - 1 733 523          |
| Autres actifs                  | -                  | -                    | -                  | 56 727 156                | 56 727 156           |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>405 431 906</b> | <b>1 200 024 402</b> | <b>132 859 273</b> | <b>56 727 156</b>         | <b>1 795 042 737</b> |
| Autres passifs                 | -                  | -                    | -                  | (50 695 920)              | (50 695 920)         |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>           | <b>-</b>             | <b>-</b>           | <b>(50 695 920)</b>       | <b>(50 695 920)</b>  |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                    |                      |                    |                           | <b>1 744 346 817</b> |

#### SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à 1 an      | De 1-5 ans        | Plus de 5 ans    | Ne portant pas intérêt | Total              |
|--------------------------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------------|--------------------|
|                                | USD               | USD               | USD              | USD                    | USD                |
| Trésorerie et soldes bancaires | 551 670           | -                 | -                | -                      | 551 670            |
| Valeurs mobilières             | 32 570 570        | 90 125 385        | 1 489 355        | -                      | 124 185 310        |
| Autres actifs                  | -                 | -                 | -                | 1 349 146              | 1 349 146          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>33 122 240</b> | <b>90 125 385</b> | <b>1 489 355</b> | <b>1 349 146</b>       | <b>126 086 126</b> |
| Autres passifs                 | -                 | -                 | -                | (1 003 752)            | (1 003 752)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>          | <b>-</b>          | <b>-</b>         | <b>(1 003 752)</b>     | <b>(1 003 752)</b> |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                   |                   |                  |                        | <b>125 082 374</b> |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

#### Risque de taux d'intérêt (suite)

#### 31 mars 2022 (suite)

##### SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF

|                                | Jusqu'à<br>1 an    | De 1-<br>5 ans | Plus de<br>5 ans | Ne portant<br>pas intérêt | Total               |
|--------------------------------|--------------------|----------------|------------------|---------------------------|---------------------|
|                                | USD                | USD            | USD              | USD                       | USD                 |
| Trésorerie et soldes bancaires | 682 732            | -              | -                | -                         | 682 732             |
| Valeurs mobilières             | 114 590 737        | -              | -                | -                         | 114 590 737         |
| Instruments financiers dérivés | -                  | -              | -                | 387 323                   | 387 323             |
| Autres actifs                  | -                  | -              | -                | 70 276 843                | 70 276 843          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>115 273 469</b> | <b>-</b>       | <b>-</b>         | <b>70 664 166</b>         | <b>185 937 635</b>  |
| Instruments financiers dérivés | -                  | -              | -                | (13 756)                  | (13 756)            |
| Autres passifs                 | -                  | -              | -                | (70 665 633)              | (70 665 633)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>           | <b>-</b>       | <b>-</b>         | <b>(70 679 389)</b>       | <b>(70 679 389)</b> |
| <b>Total des actifs nets</b>   | <b>115 258 246</b> |                |                  |                           |                     |

##### SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à 1 an       | De 1-5 ans         | Plus de 5 ans | Ne portant pas intérêt | Total               |
|--------------------------------|--------------------|--------------------|---------------|------------------------|---------------------|
|                                | EUR                | EUR                | EUR           | EUR                    | EUR                 |
| Trésorerie et soldes bancaires | 1 988 330          | -                  | -             | -                      | 1 988 330           |
| Valeurs mobilières             | -                  | 703 920 934        | -             | -                      | 703 920 934         |
| Autres actifs                  | -                  | -                  | -             | 52 965 366             | 52 965 366          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>1 988 330</b>   | <b>703 920 934</b> | <b>-</b>      | <b>52 965 366</b>      | <b>758 874 630</b>  |
| Autres passifs                 | -                  | -                  | -             | (48 232 821)           | (48 232 821)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>           | <b>-</b>           | <b>-</b>      | <b>(48 232 821)</b>    | <b>(48 232 821)</b> |
| <b>Total des actifs nets</b>   | <b>710 641 809</b> |                    |               |                        |                     |

##### SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à<br>1 an    | De 1-5 ans         | Plus de<br>5 ans | Ne portant<br>pas intérêt | Total              |
|--------------------------------|--------------------|--------------------|------------------|---------------------------|--------------------|
|                                | USD                | USD                | USD              | USD                       | USD                |
| Trésorerie et soldes bancaires | 279 544            | -                  | -                | -                         | 279 544            |
| Valeurs mobilières             | -                  | 137 509 767        | 1 172 072        | -                         | 1 311 681 839      |
| Autres actifs                  | -                  | -                  | -                | 6 350 105                 | 6 350 105          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>279 544</b>     | <b>137 509 767</b> | <b>1 172 072</b> | <b>6 350 105</b>          | <b>145 311 488</b> |
| Autres passifs                 | -                  | -                  | -                | (5 985 347)               | (5 985 347)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>           | <b>-</b>           | <b>-</b>         | <b>(5 985 347)</b>        | <b>(5 985 347)</b> |
| <b>Total des actifs nets</b>   | <b>139 326 141</b> |                    |                  |                           |                    |

##### SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à 1 an      | De 1-5 ans           | Plus de 5 ans  | Ne portant pas intérêt | Total             |
|--------------------------------|-------------------|----------------------|----------------|------------------------|-------------------|
|                                | USD               | USD                  | USD            | USD                    | USD               |
| Trésorerie et soldes bancaires | 382 391           | -                    | -              | -                      | 382 391           |
| Valeurs mobilières             | -                 | 35 580 130 34        | 172 950        | -                      | 69 753 080        |
| Autres actifs                  | -                 | -                    | -              | 585 698                | 585 698           |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>382 391</b>    | <b>35 580 130 34</b> | <b>172 950</b> | <b>585 698</b>         | <b>70 721 169</b> |
| Autres passifs                 | -                 | -                    | -              | (72 027)               | (72 027)          |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>          | <b>-</b>             | <b>-</b>       | <b>(72 027)</b>        | <b>(72 027)</b>   |
| <b>Total des actifs nets</b>   | <b>70 649 142</b> |                      |                |                        |                   |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

#### Risque de taux d'intérêt (suite)

#### SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

|   | Jusqu'à<br>1 an    | De 1-5 ans           | Plus de 5 ans        | Ne portant<br>pas intérêt | Total                |
|---|--------------------|----------------------|----------------------|---------------------------|----------------------|
|   | USD                | USD                  | USD                  | USD                       | USD                  |
| Trésorerie et soldes bancaires          | 48 387 621         | -                    | -                    | -                         | 48 387 621           |
| Liquidités détenues auprès de courtiers | 4 600 000          | -                    | -                    | -                         | 4 600 000            |
| Valeurs mobilières                      | 99 043 863         | 1 138 637 005        | 1 715 488 204        | - 2 953 169 072           |                      |
| Instruments financiers dérivés          | -                  | -                    | -                    | 2 398 221                 | 2 398 221            |
| Autres actifs                           | -                  | -                    | -                    | 64 781 050                | 64 781 050           |
| <b>Total des actifs</b>                 | <b>152 031 484</b> | <b>1 138 637 005</b> | <b>1 715 488 204</b> | <b>67 179 271</b>         | <b>3 073 335 964</b> |
| Instruments financiers dérivés          | -                  | -                    | -                    | (7 101 054)               | (7 101 054)          |
| Autres passifs                          | -                  | -                    | -                    | (34 842 956)              | (34 842 956)         |
| <b>Total des passifs</b>                | <b>-</b>           | <b>-</b>             | <b>-</b>             | <b>(41 944 010)</b>       | <b>(41 944 010)</b>  |
| <b>Total des actifs nets</b>            |                    |                      |                      |                           | <b>3 031 391 954</b> |

#### SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à<br>1 an | De 1-5 ans         | Plus de 5 ans      | Ne portant<br>pas intérêt | Total               |
|--------------------------------|-----------------|--------------------|--------------------|---------------------------|---------------------|
|                                | EUR             | EUR                | EUR                | EUR                       | EUR                 |
| Trésorerie et soldes bancaires | 867 424         | -                  | -                  | -                         | 867 424             |
| Valeurs mobilières             | -               | 222 288 772        | 316 545 295        | -                         | 538 834 067         |
| Autres actifs                  | -               | -                  | -                  | 58 072 757                | 58 072 757          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>867 424</b>  | <b>222 288 772</b> | <b>316 545 295</b> | <b>58 072 757</b>         | <b>597 774 248</b>  |
| Autres passifs                 | -               | -                  | -                  | (54 450 528)              | (54 450 528)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>        | <b>-</b>           | <b>-</b>           | <b>(54 450 528)</b>       | <b>(54 450 528)</b> |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                 |                    |                    |                           | <b>543 323 720</b>  |

#### SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à 1 an     | De 1-5 ans         | Plus de 5 ans      | Ne portant pas intérêt | Total                |
|--------------------------------|------------------|--------------------|--------------------|------------------------|----------------------|
|                                | EUR              | EUR                | EUR                | EUR                    | EUR                  |
| Trésorerie et soldes bancaires | 2 501 943        | -                  | -                  | -                      | 2 501 943            |
| Valeurs mobilières             | -                | 396 104 795        | 694 036 383        | -                      | 1 090 141 178        |
| Autres actifs                  | -                | -                  | -                  | 26 465 877             | 26 465 877           |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>2 501 943</b> | <b>396 104 795</b> | <b>694 036 383</b> | <b>26 465 877</b>      | <b>1 119 108 998</b> |
| Autres passifs                 | -                | -                  | -                  | (16 721 456)           | (16 721 456)         |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>         | <b>-</b>           | <b>-</b>           | <b>(16 721 456)</b>    | <b>(16 721 456)</b>  |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                  |                    |                    |                        | <b>1 102 387 542</b> |

#### SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à un<br>an | De 1-5 ans           | Plus de 5 ans      | Ne portant pas intérêt | Total               |
|--------------------------------|------------------|----------------------|--------------------|------------------------|---------------------|
|                                | EUR              | EUR                  | EUR                | EUR                    | EUR                 |
| Trésorerie et soldes bancaires | 19 937 44        | 3                    | -                  | -                      | 19 937 443          |
| Valeurs mobilières             | -                | 353 327 143          | 194 508 022        | -                      | 547 835 165         |
| Autres actifs                  | -                | -                    | -                  | 18 464 276             | 18 464 276          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>19 937 44</b> | <b>3 353 327 143</b> | <b>194 508 022</b> | <b>18 464 276</b>      | <b>586 236 884</b>  |
| Autres passifs                 | -                | -                    | -                  | (29 498 625)           | (29 498 625)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>         | <b>-</b>             | <b>-</b>           | <b>(29 498 625)</b>    | <b>(29 498 625)</b> |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                  |                      |                    |                        | <b>556 738 259</b>  |

#### SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à<br>1 an   | De 1-5 ans         | Plus de 5 ans        | Ne portant pas intérêt | Total                |
|--------------------------------|-------------------|--------------------|----------------------|------------------------|----------------------|
|                                | USD               | USD                | USD                  | USD                    | USD                  |
| Trésorerie et soldes bancaires | 41 783 159        | -                  | -                    | -                      | 41 783 159           |
| Valeurs mobilières             | 15 693 875        | 706 477 653        | 1 153 105 537        | -                      | 1 875 277 065        |
| Instruments financiers dérivés | -                 | -                  | -                    | 36 597 503             | 36 597 503           |
| Autres actifs                  | -                 | -                  | -                    | 28 084 489             | 28 084 489           |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>57 477 034</b> | <b>706 477 653</b> | <b>1 153 105 537</b> | <b>64 681 992</b>      | <b>1 981 742 216</b> |
| Instruments financiers dérivés | -                 | -                  | -                    | (7 384 271)            | (7 384 271)          |
| Autres passifs                 | -                 | -                  | -                    | (59 301 778)           | (59 301 778)         |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>          | <b>-</b>           | <b>-</b>             | <b>(66 686 049)</b>    | <b>(66 686 049)</b>  |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                   |                    |                      |                        | <b>1 915 056 167</b> |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

##### Risque de taux d'intérêt (suite)

#### SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF

|                                | Jusqu'à 1 an   | De 1-5 ans         | Plus de 5 ans      | Ne portant pas intérêt | Total              |
|--------------------------------|----------------|--------------------|--------------------|------------------------|--------------------|
|                                | USD            | USD                | USD                | USD                    | USD                |
| Trésorerie et soldes bancaires | 845 000        | -                  | -                  | -                      | 845 000            |
| Valeurs mobilières             | -              | 189 924 289        | 225 490 895        | -                      | 415 415 184        |
| Autres actifs                  | -              | -                  | -                  | 4 356 562              | 4 356 562          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>845 000</b> | <b>189 924 289</b> | <b>225 490 895</b> | <b>4 356 562</b>       | <b>420 616 746</b> |
| Autres passifs                 | -              | -                  | -                  | (4 007 666)            | (4 007 666)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>       | <b>-</b>           | <b>-</b>           | <b>(4 007 666)</b>     | <b>(4 007 666)</b> |

Total des actifs nets

**416 609 080**

#### SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF

|                                | Jusqu'à 1 an   | De 1-5 ans         | Plus de 5 ans      | Ne portant pas intérêt | Total               |
|--------------------------------|----------------|--------------------|--------------------|------------------------|---------------------|
|                                | USD            | USD                | USD                | USD                    | USD                 |
| Trésorerie et soldes bancaires | 825 311        | -                  | -                  | -                      | 825 311             |
| Valeurs mobilières             | -              | 273 246 654        | 245 906 208        | -                      | 519 152 862         |
| Autres actifs                  | -              | -                  | -                  | 59 326 649             | 59 326 649          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>825 311</b> | <b>273 246 654</b> | <b>245 906 208</b> | <b>59 326 649</b>      | <b>579 304 822</b>  |
| Autres passifs                 | -              | -                  | -                  | (57 336 268)           | (57 336 268)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>       | <b>-</b>           | <b>-</b>           | <b>(57 336 268)</b>    | <b>(57 336 268)</b> |

Total des actifs nets

**521 968 554**

#### SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF\*

|                                | Jusqu'à 1 an   | De 1-5 ans        | Plus de 5 ans     | Ne portant pas intérêt | Total              |
|--------------------------------|----------------|-------------------|-------------------|------------------------|--------------------|
|                                | USD            | USD               | USD               | USD                    | USD                |
| Trésorerie et soldes bancaires | 159 266        | -                 | -                 | -                      | 159 266            |
| Valeurs mobilières             | -              | 15 233 208        | 14 510 422        | -                      | 29 743 630         |
| Autres actifs                  | -              | -                 | -                 | 5 375 928              | 5 375 928          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>159 266</b> | <b>15 233 208</b> | <b>14 510 422</b> | <b>5 375 928</b>       | <b>35 278 824</b>  |
| Autres passifs                 | -              | -                 | -                 | (5 070 906)            | (5 070 906)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>       | <b>-</b>          | <b>-</b>          | <b>(5 070 906)</b>     | <b>(5 070 906)</b> |

Total des actifs nets

**30 207 918**

\* Le Compartiment a été lancé le 10 novembre 2021.

#### SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF

|                                | Jusqu'à 1 an   | De 1-5 ans        | Plus de 5 ans     | Ne portant pas intérêt | Total              |
|--------------------------------|----------------|-------------------|-------------------|------------------------|--------------------|
|                                | EUR            | EUR               | EUR               | EUR                    | EUR                |
| Trésorerie et soldes bancaires | 662 463        | -                 | -                 | -                      | 662 463            |
| Valeurs mobilières             | -              | 32 984 688        | 36 656 182        | -                      | 69 640 870         |
| Autres actifs                  | -              | -                 | -                 | 2 420 014              | 2 420 014          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>662 463</b> | <b>32 984 688</b> | <b>36 656 182</b> | <b>2 420 014</b>       | <b>72 723 347</b>  |
| Autres passifs                 | -              | -                 | -                 | (2 257 921)            | (2 257 921)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>       | <b>-</b>          | <b>-</b>          | <b>(2 257 921)</b>     | <b>(2 257 921)</b> |

Total des actifs nets

**70 465 426**

#### SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

|                                | Jusqu'à 1 an      | De 1-5 ans           | Plus de 5 ans      | Ne portant pas intérêt | Total                          |
|--------------------------------|-------------------|----------------------|--------------------|------------------------|--------------------------------|
|                                | USD               | USD                  | USD                | USD                    | USD                            |
| Trésorerie et soldes bancaires | 38 878 784        | -                    | -                  | -                      | 38 878 784                     |
| Valeurs mobilières             | -                 | 2 244 780 004        | 597 919 872        | -                      | 6 842 699 872                  |
| Instruments financiers dérivés | -                 | -                    | -                  | 757 103                | 757 103                        |
| Autres actifs                  | -                 | -                    | -                  | 158 711 746            | 158 711 746                    |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>38 878 784</b> | <b>2 244 780 004</b> | <b>597 919 872</b> | <b>159 468 849</b>     | <b>159 468 849 041 047 505</b> |
| Instruments financiers dérivés | -                 | -                    | -                  | (1 732 762)            | (1 732 762)                    |
| Autres passifs                 | -                 | -                    | -                  | (133 252 004)          | (133 252 004)                  |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>          | <b>-</b>             | <b>-</b>           | <b>(133 252 004)</b>   | <b>(133 252 004)</b>           |

Total des actifs nets

**6 906 062 739**

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

##### Risque de taux d'intérêt (suite)

#### SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF\*

|                                | Jusqu'à          |                   | Plus de 5 ans     | Ne portant pas intérêt | Total              |
|--------------------------------|------------------|-------------------|-------------------|------------------------|--------------------|
|                                | 1 an             | De 1-5 ans        |                   |                        |                    |
|                                | USD              | USD               | USD               | USD                    | USD                |
| Trésorerie et soldes bancaires | 1 889 033        | -                 | -                 | -                      | 1 889 033          |
| Valeurs mobilières             | 1 811 528        | 56 073 967        | 77 401 862        | -                      | 135 287 357        |
| Instruments financiers dérivés | -                | -                 | -                 | 3 055                  | 3 055              |
| Autres actifs                  | -                | -                 | -                 | 3 483 776              | 3 483 776          |
| <b>Total des actifs</b>        | <b>3 700 561</b> | <b>56 073 967</b> | <b>77 401 862</b> | <b>3 486 831</b>       | <b>140 663 221</b> |
| Autres passifs                 | -                | -                 | -                 | (4 586 972)            | (4 586 972)        |
| <b>Total des passifs</b>       | <b>-</b>         | <b>-</b>          | <b>-</b>          | <b>(4 586 972)</b>     | <b>(4 586 972)</b> |
| <b>Total des actifs nets</b>   |                  |                   |                   |                        | <b>136 076 249</b> |

\* Le nom du Compartiment a changé le 29 octobre 2021.

Au 31 mars 2022, les Compartiments restants détiennent des actifs et des passifs financiers qui ne sont pas exposés au risque de taux d'intérêt. Les Compartiments ont également une exposition indirecte au risque de taux d'intérêt du fait des investissements dans les contrats à terme standardisés, dans la mesure où la valeur de l'actif sous-jacent peut fluctuer en raison de variations des taux d'intérêt.

L'analyse de sensibilité aux taux d'intérêt ci-dessous montre l'effet d'une variation des taux d'intérêt de 1 % sur la Valeur liquidative des Compartiments.

Les informations sont une estimation relative du risque et n'ont pas vocation à être un chiffre précis et exact. Les calculs sont basés sur des données historiques. Les mouvements de prix futurs et les corrélations entre les titres pourraient varier significativement de celles du passé.

| Nom du Compartiment   | Devise | Au           |              |
|---|--------|--------------|--------------|
|   |        | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
| SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF       | EUR    | 27 072 608   | 26 943 892   |
| SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF       | USD    | 2 613 186    | 1 858 581    |
| SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF                   | USD    | 450 364      | 184 438      |
| SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF      | EUR    | 11 961 394   | 13 624 049   |
| SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF        | USD    | 1 778 291    | 2 681 955    |
| SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF      | USD    | 6 628 007    | 3 092 974    |
| SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF        | USD    | 158 187 094  | 187 897 449  |
| SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF                | EUR    | 30 438 833   | 39 883 940   |
| SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF               | EUR    | 75 507 854   | 90 580 115   |
| SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF               | EUR    | 13 421 480   | 19 701 709   |
| SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF                          | USD    | 25 455 900   | 33 300 815   |
| SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF                 | USD    | 30 592 771   | 35 202 522   |
| SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF                | USD    | 1 250 871    | 1 877 902    |
| SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF            | EUR    | 3 377 395    | 3 592 500    |
| SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF            | USD    | 490 855 342  | 565 665 766  |
| SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF | USD    | 7 204 897    | 5 487 056    |

#### Risque de crédit

Les Compartiments sont exposés au risque de crédit, lequel correspond au risque que l'une des parties d'un instrument financier cause une perte financière à l'autre partie pour avoir manqué d'acquitter une obligation.

Les risques de crédit auxquels les Compartiments sont exposés se concentrent principalement sur les investissements tels que les titres de créances et le risque de crédit des contreparties des produits dérivés, les liquidités et équivalents, les montants dus par les courtiers et les autres soldes à recevoir, qui figurent dans les États de situation financière.

Il peut arriver que la capacité d'un émetteur à honorer ses obligations soit fortement réduite au cours de l'exercice ou que l'émetteur fasse défaut sur ses obligations. Une dégradation réelle ou perçue de la capacité d'un émetteur à s'acquitter de ses obligations aura vraisemblablement un effet adverse sur la valeur des titres de cet émetteur.

Les Compartiments sont soumis au risque de crédit lié aux investissements dans des titres de créance. Ce risque de crédit est géré par le service de gestion du risque permanent de la Société, tel que requis par les objectifs d'investissement des Compartiments.

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de marché (suite)

##### Risque de taux d'intérêt (suite)

Les titres et liquidités des Compartiments sont détenus au sein du réseau du dépositaire au 31 mars 2023 et au 31 mars 2022. Les détails du risque de crédit lié aux actifs détenus auprès du Dépositaire sont présentés à la section Risque de Dépositaire.

##### Risque de Dépositaire

Le Dépositaire des Compartiments est State Street Custodial Services (Ireland) Limited (le « Dépositaire »). La quasi-totalité des actifs et des liquidités des Compartiments est détenue au sein du réseau du Dépositaire. Une faillite ou insolvabilité du Dépositaire ou de sa société-mère State Street Corporation peut entraîner un retard lié aux droits du Compartiment eu égard à ses investissements en titres détenus par le Dépositaire. L'exposition maximale à ce risque au 31 mars 2023 correspond à la valeur totale des investissements figurant dans le Tableau des investissements, à l'exception des instruments financiers dérivés, mais incluant la valeur des liquidités telle que détaillée dans l'État de la situation financière.

Conformément aux exigences du *Companies Act* de 2014 et de la Réglementation OPCVM, les titres des Compartiments sont conservés au sein du réseau du dépositaire dans des comptes séparés, les droits de propriété restant acquis aux Compartiments. Le Dépositaire s'assurera que tous les agents qu'il nommera pour l'aider dans le contexte de la garde des actifs des Compartiments séparent les actifs des Compartiments, à l'exception des liquidités. Les liquidités ne peuvent pas être enregistrées sous le nom d'un client ni identifiées comme étant sa propriété effective, et elles ne peuvent pas non plus être détenues physiquement dans un lieu séparé. Ainsi, en cas d'insolvabilité ou de faillite du Dépositaire, les actifs des Compartiments (hors liquidités) sont séparés et protégés et ceci réduit encore le risque de contrepartie. Les Compartiments seront néanmoins exposés au risque lié au Dépositaire, aux teneurs de compte-conservateurs délégués ou à certains dépositaires utilisés par le Dépositaire, au regard des liquidités des Compartiments détenues par le Dépositaire. En cas d'insolvabilité ou de faillite du Dépositaire, le Compartiment sera traité comme un créancier ordinaire du Dépositaire concernant les liquidités des Compartiments.

Au 31 mars 2023, State Street Corporation avait une notation de crédit de A chez Standard & Poor's (2022 : A)

##### Risque de contrepartie

Les Compartiments sont exposés au risque de crédit pour les contreparties avec lesquelles la Société, pour le compte des Compartiments, conclut des contrats sur dérivés. Le montant de l'exposition à chaque contrepartie correspond à la valeur latente des contrats dérivés tel qu'indiqué au Tableau des investissements du Compartiment concerné,

augmentée du montant de trésorerie de marge détenue par la contrepartie, le cas échéant. Si une contrepartie devient insolvable ou ne s'acquitte pas de ses obligations, un Compartiment peut enregistrer des retards importants pour obtenir un recouvrement dans le cas d'une procédure d'insolvabilité, de faillite ou de réorganisation et peut n'obtenir qu'un recouvrement limité, voire aucun recouvrement. En cas d'insolvabilité, les garanties détenues par la contrepartie seront disponibles pour compenser la position nette du Compartiment.

Au 31 mars 2023, les contreparties aux divers contrats dérivés et leurs notations de crédit respectives étaient les suivantes :

Bank of America (A+) (2022 : A+), Bank of Montreal (A+) (2022 : A+), Barclays Bank (A) (2022 : A), Barclays Capital (A) (2022 : A), BNP Paribas (A+) (2022 : A+), Citibank (A+) (2022 : A+), Deutsche Bank (A-) (2022 : A-), Goldman Sachs (A+) (2022 : A+), HSBC Bank (A+) (2022 : A+), JP Morgan Chase Bank (A-) (2022 : A+), Merrill Lynch International (A+) (2022 : A+), Mizuho Securities (A) (2022 : A), Morgan Stanley (A+) (2022 : BBB+), Royal Bank of Canada (AA-) (2022 : AA-), Standard Chartered Bank (A+) (2022 : A+), State Street Bank and Trust Company (AA-) (2022 : AA-), Toronto Dominion Bank (AA-) (2022 : AA-), UBS AG (A+) (2022 : A+), Wells Fargo & Company (A+) (2022 : A+) et Westpac Banking Corporation (AA-) (2022 : AA-).

Le service de gestion du risque permanent de la Société contrôlera la conformité par rapport au système de limite du risque OPCVM, incluant le risque de contrepartie (à savoir, le risque lié aux opérations souscrites avec une autre contrepartie et à l'exécution des obligations de ladite contrepartie, en particulier dans le cadre de dérivés de gré à gré) conformément à la Réglementation OPCVM.

Les actifs et passifs financiers sont compensés et le montant net est reporté dans l'État de la situation financière lorsqu'il existe un droit juridiquement exécutoire d'imposer la compensation des montants comptabilisés et une intention d'effectuer le règlement sur une base nette, ou de réaliser les actifs et régler les passifs simultanément. IFRS 7 – Instruments financiers : L'amendement (« Norme IFRS 7 ») exige la divulgation des instruments dérivés financiers qui ont été compensés dans l'État de la situation financière, ou qui n'ont pas été compensés dans l'État de la situation financière, mais qui sont soumis à un accord-cadre de compensation exécutoire ou à un accord similaire. Au 31 mars 2023 et au 31 mars 2022, il n'y avait pas d'instruments dérivés financiers compensés dans l'État de la situation financière. Les instruments financiers dérivés financiers détenus par les Compartiments sont des contrats à terme standardisés, ainsi que des contrats de change à terme. Les montants correspondant à ces contrats dans l'État de la situation financière sont publiés sur une base brute.



## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

##### *Risque de contrepartie (suite)*

À l'exception du Compartiment SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS EFT Fund pour les exercices clôturés le 31 mars 2023 et le 31 mars 2022, aucune garantie sous forme de titres n'a été nantie relativement à la gestion efficace de portefeuille et aux instruments financiers dérivés de gré à gré au cours des exercices clôturés les 31 mars 2023 et 31 mars 2022. Veuillez vous référer au Tableau des investissements pour plus d'informations.

Les tableaux suivants présentent, au niveau d'un Compartiment, les actifs et passifs financiers des Compartiments qui font l'objet de compensations, d'accords-cadres de compensation exécutoires ou d'accords similaires au 31 mars 2023. Bien que les termes et conditions de ces accords peuvent différer, toutes les transactions effectuées au titre desdits accords constituent une relation contractuelle unique entre chaque Compartiment et chaque contrepartie, individuellement et non conjointement. L'obligation faite à chacun des Compartiments de procéder aux paiements, livraisons ou autres transferts qui touchent aux transactions réalisées dans le cadre desdits accords peut être compensée par les obligations de la contrepartie à ces accords. Tout défaut d'exécution de l'une ou l'autre partie concernant une transaction relevant de l'un de ces accords autorisera de fait l'autre partie à clôturer l'ensemble des transactions relevant de l'accord en question et à calculer le montant net dû par l'une des parties à l'autre partie. Les informations complémentaires relatives à l'exposition des Compartiments aux contreparties des différents contrats dérivés sont présentées dans le Tableau des investissements des Compartiments concernés.

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2023

| SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
|---|--|---|---|--|-----------------------------|-------------|
| Description                               | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>                  |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats de change à terme</b>         |  |   |   |  |                             |             |
| Citibank                                  | 77 029   | -   | 77 029  | (5 920)  | -                           | 71 109      |
| Goldman Sachs                             | 71 278   | -   | 71 278  | -  | -                           | 71 278      |
| HSBC Bank                                 | 7 882  | -   | 7 882   | (7 317)  | -                           | 565         |
| JP Morgan Chase Bank                      | 71 147   | -   | 71 147  | -  | -                           | 71 147      |
| Merrill Lynch International               | 6 908  | -   | 6 908   | (6 430)  | -                           | 478         |
| Royal Bank of Canada                      | 70 913   | -   | 70 913  | -  | -                           | 70 913      |
| Westpac Banking Corporation               | 14 800   | -   | 14 800  | (7 070)  | -                           | 7 730       |

| SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF |   |   |  | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                              |             |
|---|---|---|--|--|------------------------------|-------------|
| Description                               | Montants bruts des passifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des passifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires remises | Montant net |
| <b>Passifs financiers</b>                 |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Contrats de change à terme</b>         |   |   |  |  |                              |             |
| Citibank                                  | (5 920)   | -   | (5 920)  | 5 920  | -                            | -           |
| HSBC Bank                                 | (7 317)   | -   | (7 317)  | 7 317  | -                            | -           |
| Merrill Lynch International               | (6 430)   | -   | (6 430)  | 6 430  | -                            | -           |
| Westpac Banking Corporation               | (7 070)   | -   | (7 070)  | 7 070  | -                            | -           |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2023 (suite)

| SPDR Bloomberg Emerging Markets Local<br>Bond UCITS ETF |   |   |  | Montants connexes non<br>compensés dans l'État de la<br>situation financière |                                   |                |
|---|---|---|--|--|-----------------------------------|----------------|
| Description   | Montants bruts<br>des actifs<br>financiers<br>comptabilisés | Montants bruts<br>compensés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière | Montants nets<br>des actifs<br>présentés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière | Instruments<br>financiers  | Garanties<br>numéraires<br>reçues | Montant<br>net |
| <b>Actifs financiers</b>                                |   |   |  |  |                                   |                |
| <b>Contrats de change à terme</b>                       |   |   |  |  |                                   |                |
| Barclays Bank   | 161 341   | -   | 161 341  | (41 628)   | -                                 | 119 713        |
| BNP Paribas   | 2 588   | -   | 2 588  | (2 588)  | -                                 | -              |
| Citibank  | 134 804   | -   | 134 804  | (74 084)   | -                                 | 60 720         |
| Goldman Sachs   | 1 606 656   | -   | 1 606 656  | (452 219)  | -                                 | 1 154 437      |
| HSBC Bank   | 1 455 824   | -   | 1 455 824  | (9 013)  | -                                 | 1 446 811      |
| Morgan Stanley  | 19 373  | -   | 19 373   | -  | -                                 | 19 373         |
| UBS AG  | 1 525 238   | -   | 1 525 238  | (73 366)   | -                                 | 1 451 872      |
| Westpac Banking Corporation                             | 1 417 279   | -   | 1 417 279  | (166 473)  | -                                 | 1 250 806      |

| SPDR Bloomberg Emerging Markets Local<br>Bond UCITS ETF |  |   |   | Montants connexes non<br>compensés dans l'État de la<br>situation financière |                                    |                |
|---|--|---|---|--|------------------------------------|----------------|
| Description   | Montants bruts<br>des passifs<br>financiers<br>comptabilisés | Montants bruts<br>compensés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière | Montants nets<br>des passifs<br>présentés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière | Instruments<br>financiers  | Garanties<br>numéraires<br>remises | Montant<br>net |
| <b>Passifs financiers</b>                               |  |   |   |  |                                    |                |
| <b>Contrats de change à terme</b>                       |  |   |   |  |                                    |                |
| Barclays Bank   | (41 628)   | -   | (41 628)  | 41 628   | -                                  | -              |
| BNP Paribas   | (264 425)  | -   | (264 425)   | 2 588  | -                                  | (261 837)      |
| Citibank  | (74 084)   | -   | (74 084)  | 74 084   | -                                  | -              |
| Goldman Sachs   | (452 219)  | -   | (452 219)   | 452 219  | -                                  | -              |
| HSBC Bank   | (9 013)  | -   | (9 013)   | 9 013  | -                                  | -              |
| Merrill Lynch International                             | (4 879)  | -   | (4 879)   | -  | -                                  | (4 879)        |
| UBS AG  | (73 366)   | -   | (73 366)  | 73 366   | -                                  | -              |
| Westpac Banking Corporation                             | (166 473)  | -   | (166 473)   | 166 473  | -                                  | -              |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2023 (suite)

| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF  |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
|---|--|---|---|--|-----------------------------|-------------|
| Description                                     | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>                        |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats de change à terme et Titres TBA</b> |  |   |   |  |                             |             |
| Bank of America                                 | 877 663  | -   | 877 663   | -  | -                           | 877 663     |
| Barclays Bank                                   | 14 963 913   | -   | 14 963 913  | (528 604)  | -                           | 14 435 309  |
| BNP Paribas                                     | 1 652 599  | -   | 1 652 599   | (1 652 599)  | -                           | -           |
| Citibank  | 3 886 702  | -   | 3 886 702   | (642 755)  | -                           | 3 243 947   |
| Citigroup                                       | 2 160 498  | -   | 2 160 498   | -  | -                           | 2 160 498   |
| Goldman Sachs                                   | 8 974 206  | -   | 8 974 206   | (2 819 485)  | -                           | 6 154 721   |
| HSBC Bank                                       | 2 856 443  | -   | 2 856 443   | (2 856 443)  | -                           | -           |
| JP Morgan Chase Bank                            | 3 580 378  | -   | 3 580 378   | (3 236 238)  | -                           | 344 140     |
| Merrill Lynch International                     | 1 382 677  | -   | 1 382 677   | (587 026)  | -                           | 795 651     |
| Mizuho Securities                               | 637 051  | -   | 637 051   | -  | -                           | 637 051     |
| Morgan Stanley                                  | 9 298 920  | -   | 9 298 920   | -  | -                           | 9 298 920   |
| Royal Bank of Canada                            | 368 168  | -   | 368 168   | (368 168)  | -                           | -           |
| Standard Chartered Bank                         | 764  | -   | 764   | (593)  | -                           | 171         |
| State Street Bank                               | 10 650   | -   | 10 650  | -  | -                           | 10 650      |
| UBS AG  | 1 825 158  | -   | 1 825 158   | (469 644)  | -                           | 1 355 514   |
| Westpac Banking Corporation                     | 5 874 882  | -   | 5 874 882   | (1 482 744)  | -                           | 4 392 138   |
| Wells Fargo & Company                           | 395 251  | -   | 395 251   | -  | -                           | 395 251     |

| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF  |   |   |  | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                              |             |
|---|---|---|--|--|------------------------------|-------------|
| Description                                     | Montants bruts des passifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des passifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires remises | Montant net |
| <b>Passifs financiers</b>                       |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Contrats de change à terme et Titres TBA</b> |   |   |  |  |                              |             |
| Barclays Bank                                   | (528 604)   | -   | (528 604)  | 528 604  | -                            | -           |
| BNP Paribas                                     | (1 847 237)   | -   | (1 847 237)  | 1 652 599  | -                            | (194 638)   |
| Citibank  | (642 755)   | -   | (642 755)  | 642 755  | -                            | -           |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2023 (suite)

| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond<br>UCITS ETF |  |   |   | Montants connexes non<br>compensés dans l'État de la<br>situation financière |                                    |                |
|---|--|---|---|--|------------------------------------|----------------|
| Description                                       | Montants bruts<br>des passifs<br>financiers<br>comptabilisés | Montants bruts<br>compensés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière | Montants nets<br>des passifs<br>présentés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière | Instruments<br>financiers  | Garanties<br>numéraires<br>remises | Montant<br>net |
| <b>Passifs financiers</b>                         |  |   |   |  |                                    |                |
| <b>Contrats de change à terme et Titres TBA</b>   |  |   |   |  |                                    |                |
| Deutsche Bank                                     | (3 600)  | -   | (3 600)   | -  | -                                  | (3 600)        |
| Goldman Sachs                                     | (2 819 485)  | -   | (2 819 485)   | 2 819 485  | -                                  | -              |
| HSBC Bank   | (3 151 015)  | -   | (3 151 015)   | 2 856 443  | -                                  | (294 572)      |
| JP Morgan Chase Bank                              | (3 236 238)  | -   | (3 236 238)   | 3 236 238  | -                                  | -              |
| Merrill Lynch International                       | (587 026)  | -   | (587 026)   | 587 026  | -                                  | -              |
| Royal Bank of Canada                              | (1 202 277)  | -   | (1 202 277)   | 368 168  | -                                  | (834 109)      |
| Standard Chartered Bank                           | (593)  | -   | (593)   | 593  | -                                  | -              |
| UBS AG  | (469 644)  | -   | (469 644)   | 469 644  | -                                  | -              |
| Westpac Banking Corporation                       | (1 482 744)  | -   | (1 482 744)   | 1 482 744  | -                                  | -              |

| SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG<br>UCITS ETF |   |   |  | Montants connexes non<br>compensés dans l'État de la<br>situation financière |                                   |                |
|---|---|---|--|--|-----------------------------------|----------------|
| Description   | Montants bruts<br>des actifs<br>financiers<br>comptabilisés | Montants bruts<br>compensés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière | Montants nets<br>des actifs<br>présentés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière | Instruments<br>financiers  | Garanties<br>numéraires<br>reçues | Montant<br>net |
| <b>Actifs financiers</b>                            |   |   |  |  |                                   |                |
| <b>Contrats de change à terme</b>                   |   |   |  |  |                                   |                |
| BNP Paribas   | 4 949   | -   | 4 949  | (4 949)  | -                                 | -              |
| Citibank  | 4 438   | -   | 4 438  | (4 438)  | -                                 | -              |
| Goldman Sachs                                       | 2 069 197   | -   | 2 069 197  | -  | -                                 | -2 069 197     |
| HSBC Bank   | 2 095 677   | -   | 2 095 677  | (12 961)   | -                                 | -2 082 716     |
| Merrill Lynch International                         | 13 106  | -   | 13 106   | (1 061)  | -                                 | 12 045         |
| Standard Chartered Bank                             | 8 294   | -   | 8 294  | -  | -                                 | 8 294          |
| UBS AG  | 2 076 405   | -   | 2 076 405  | -  | -                                 | -2 076 405     |
| Westpac Banking Corporation                         | 2 109 910   | -   | 2 109 910  | (371 017)  | -                                 | -1 738 893     |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2023 (suite)

| Description   | Montants bruts des passifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des passifs présentés dans l'État de la situation financière | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                              |             |
|---|---|---|--|--|------------------------------|-------------|
|   |   |   |  | Instruments financiers   | Garanties numéraires remises | Montant net |
| <b>SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF</b> |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Passifs financiers</b>                               |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Contrats de change à terme</b>                       |   |   |  |  |                              |             |
| BNP Paribas   | (353 252)   | -   | (353 252)  | 4 949  | -                            | (348 303)   |
| Citibank  | (5 439)   | -   | (5 439)  | 4 438  | -                            | (1 001)     |
| HSBC Bank   | (12 961)  | -   | (12 961)   | 12 961   | -                            | -           |
| Merrill Lynch International                             | (1 061)   | -   | (1 061)  | 1 061  | -                            | -           |
| Royal Bank of Canada                                    | (2 252)   | -   | (2 252)  | -  | -                            | (2 252)     |
| Westpac Banking Corporation                             | (371 017)   | -   | (371 017)  | 371 017  | -                            | -           |

| Description  | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
|--|--|---|---|--|-----------------------------|-------------|
|  |  |   |   | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF</b> |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Actifs financiers</b>   |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats de change à terme</b>                                  |  |   |   |  |                             |             |
| Bank of America  | 357 817  | -   | 357 817   | -  | -                           | 357 817     |
| Bank of Montreal   | 354 904  | -   | 354 904   | (54 225)   | -                           | 300 679     |
| Citibank   | 422 993  | -   | 422 993   | (48 743)   | -                           | 374 250     |
| Morgan Stanley   | 41 058   | -   | 41 058  | (41 058)   | -                           | -           |
| Royal Bank of Canada   | 51 689   | -   | 51 689  | (51 689)   | -                           | -           |
| Westpac Banking Corporation  | 407 665  | -   | 407 665   | (49 982)   | -                           | 357 683     |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2023 (suite)

| SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield<br>Corporate ESG UCITS ETF |  |   |   | Montants connexes non<br>compensés dans l'État de la<br>situation financière |                                    |                |
|--|--|---|---|--|------------------------------------|----------------|
| Description  | Montants bruts<br>des passifs<br>financiers<br>comptabilisés | Montants bruts<br>compensés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière | Montants nets<br>des passifs<br>présentés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière | Instruments<br>financiers  | Garanties<br>numéraires<br>remises | Montant<br>net |
| <b>Passifs financiers</b>                                      |  |   |   |  |                                    |                |
| <b>Contrats de change à terme</b>                              |  |   |   |  |                                    |                |
| Bank of Montreal   | (54 225)   | -   | (54 225)  | 54 225   | -                                  | -              |
| Citibank   | (48 743)   | -   | (48 743)  | 48 743   | -                                  | -              |
| Morgan Stanley   | (42 059)   | -   | (42 059)  | 41 058   | -                                  | (1 001)        |
| Royal Bank of Canada   | (51 929)   | -   | (51 929)  | 51 689   | -                                  | (240)          |
| Westpac Banking Corporation                                    | (49 982)   | -   | (49 982)  | 49 982   | -                                  | -              |

| SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS<br>ETF |   |   |  | Montants connexes non<br>compensés dans l'État de la<br>situation financière |                                   |                |
|--|---|---|--|--|-----------------------------------|----------------|
| Description                                    | Montants bruts<br>des actifs<br>financiers<br>comptabilisés | Montants bruts<br>compensés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière | Montants nets<br>des actifs<br>présentés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière | Instruments<br>financiers  | Garanties<br>numéraires<br>reçues | Montant<br>net |
| <b>Actifs financiers</b>                       |   |   |  |  |                                   |                |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>           |   |   |  |  |                                   |                |
| Goldman Sachs                                  | 24 382  | -   | 24 382   | -  | -                                 | 24 382         |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2023 (suite)

|  |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
|--|--|---|---|--|-----------------------------|-------------|
| Description  | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF</b>                          |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Actifs financiers</b>   |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>                               |  |   |   |  |                             |             |
| Goldman Sachs  | 78 731   | -   | 78 731  | -  | -                           | 78 731      |
|  |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
| <b>SPDR MSCI ACWI UCITS ETF</b>                                    |  |   |   |  |                             |             |
| Description  | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>   |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats de change à terme et Contrats à terme standardisés</b> |  |   |   |  |                             |             |
| Barclays Bank  | 7 178  | -   | 7 178   | (7 178)  | -                           | -           |
| Barclays Capital   | 222 298  | -   | 222 298   | -  | -                           | 222 298     |
| BNP Paribas  | 1 653 378  | -   | 1 653 378   | (25 806)   | -                           | 1 627 572   |
| Citibank   | 4 644  | -   | 4 644   | -  | -                           | 4 644       |
| Deutsche Bank  | 899  | -   | 899   | -  | -                           | 899         |
| HSBC Bank  | 630 084  | -   | 630 084   | (7 985)  | -                           | 622 099     |
| UBS AG   | 1 691 006  | -   | 1 691 006   | (66 325)   | -                           | 1 624 681   |
| Westpac Banking Corporation  | 1 689 064  | -   | 1 689 064   | (211 004)  | -                           | 1 478 060   |



## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2023 (suite)

| Description                       | Montants bruts des passifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des passifs présentés dans l'État de la situation financière | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                              |
|-----------------------------------|---|---|--|--|------------------------------|
|                                   |   |   |  | Instruments financiers   | Garanties numéraires remises |
| <b>SPDR MSCI ACWI UCITS ETF</b>   |   |   |  |  |                              |
| <b>Passifs financiers</b>         |   |   |  |  |                              |
| <b>Contrats de change à terme</b> |   |   |  |  |                              |
| Barclays Bank                     | (30 552)  | -   | (30 552)   | 7 178  | - (23 374)                   |
| BNP Paribas                       | (25 806)  | -   | (25 806)   | 25 806   | - -                          |
| HSBC Bank                         | (7 985)   | -   | (7 985)  | 7 985  | - -                          |
| JP Morgan Chase Bank              | (77 822)  | -   | (77 822)   | -  | - (77 822)                   |
| Merrill Lynch International       | (20 112)  | -   | (20 112)   | -  | - (20 112)                   |
| UBS AG                            | (66 325)  | -   | (66 325)   | 66 325   | - -                          |
| Westpac Banking Corporation       | (211 004)   | -   | (211 004)  | 211 004  | - -                          |

| Description                          | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |
|--------------------------------------|--|---|---|--|-----------------------------|
|                                      |  |   |   | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues |
| <b>SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF</b>   |  |   |   |  |                             |
| <b>Actifs financiers</b>             |  |   |   |  |                             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b> |  |   |   |  |                             |
| Barclays Capital                     | 26 471   | -   | 26 471  | (5 670)  | - 20 801                    |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2023 (suite)

|                                      |   |   |  | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                              |             |
|--------------------------------------|---|---|--|--|------------------------------|-------------|
| Description                          | Montants bruts des passifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des passifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires remises | Montant net |
| <b>SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF</b>   |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Passifs financiers</b>            |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b> |   |   |  |  |                              |             |
| Barclays Capital                     | (5 670)   | -   | (5 670)  | 5 670  | -                            | -           |
|                                      |   |   |  | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                              |             |
| <b>SPDR MSCI EMU UCITS ETF</b>       |   |   |  |  |                              |             |
| Description                          | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés  | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière  | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues  | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>             |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b> |   |   |  |  |                              |             |
| Goldman Sachs                        | 4 560   | -   | 4 560  | -  | -                            | 4 560       |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2023 (suite)

| SPDR MSCI Japan UCITS ETF  |  |   |   |                        |                             |             | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |
|--|--|---|---|------------------------|-----------------------------|-------------|--|
| Description  | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers | Garanties numéraires reçues | Montant net |  |
| <b>Actifs financiers</b>   |  |   |   |                        |                             |             |  |
| <b>Contrats de change à terme et Contrats à terme standardisés</b> |  |   |   |                        |                             |             |  |
| Barclays Bank  | 3 060 390  | -   | 3 060 390   | (248 953)              | -                           | 2 811 437   |  |
| BNP Paribas  | 4 110 808  | -   | 4 110 808   | -                      | -                           | 4 110 808   |  |
| Goldman Sachs  | 3 551 062  | -   | 3 551 062   | -                      | -                           | 3 551 062   |  |
| Merrill Lynch International  | 2 162 073  | -   | 2 162 073   | (77 293)               | -                           | 2 084 780   |  |
| State Street Bank  | 2 167 888  | -   | 2 167 888   | -                      | -                           | 2 167 888   |  |
| Westpac Banking Corporation  | 4 250 293  | -   | 4 250 293   | (1 076 816)            | -                           | 3 173 477   |  |

| SPDR MSCI Japan UCITS ETF         |   |   |  |                        |                              |             | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |
|-----------------------------------|---|---|--|------------------------|------------------------------|-------------|--|
| Description                       | Montants bruts des passifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des passifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers | Garanties numéraires remises | Montant net |  |
| <b>Passifs financiers</b>         |   |   |  |                        |                              |             |  |
| <b>Contrats de change à terme</b> |   |   |  |                        |                              |             |  |
| Barclays Bank                     | (248 953)   | -   | (248 953)  | 248 953                | -                            | -           |  |
| Merrill Lynch International       | (77 293)  | -   | (77 293)   | 77 293                 | -                            | -           |  |
| Royal Bank of Canada              | (747 096)   | -   | (747 096)  | -                      | -                            | (747 096)   |  |
| Westpac Banking Corporation       | (1 076 816)   | -   | (1 076 816)  | 1 076 816              | -                            | -           |  |

| SPDR MSCI World UCITS ETF            |  |   |   |                        |                             |             | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |
|--------------------------------------|--|---|---|------------------------|-----------------------------|-------------|--|
| Description                          | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers | Garanties numéraires reçues | Montant net |  |
| <b>Actifs financiers</b>             |  |   |   |                        |                             |             |  |
| <b>Contrats à terme standardisés</b> |  |   |   |                        |                             |             |  |
| Barclays Capital                     | 336 710  | -   | 336 710   | (333)                  | -                           | 336 377     |  |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2023 (suite)

|  |   |   |  | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                              |             |
|--|---|---|--|--|------------------------------|-------------|
| Description                                    | Montants bruts des passifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des passifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires remises | Montant net |
| <b>SPDR MSCI World UCITS ETF</b>               |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Passifs financiers</b>                      |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>           |   |   |  |  |                              |             |
| Barclays Capital                               | (333)   | -   | (333)  | 333  | -                            | -           |
|  |   |   |  | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                              |             |
| <b>SPDR S&amp;P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF</b> |   |   |  |  |                              |             |
| Description                                    | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés  | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière  | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues  | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>                       |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>           |   |   |  |  |                              |             |
| Goldman Sachs                                  | 23 760  | -   | 23 760   | -  | -                            | 23 760      |
|  |   |   |  | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                              |             |
| <b>SPDR S&amp;P 500 ESG Leaders UCITS ETF*</b> |   |   |  |  |                              |             |
| Description                                    | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés  | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière  | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues  | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>                       |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>           |   |   |  |  |                              |             |
| Goldman Sachs                                  | 92 680  | -   | 92 680   | -  | -                            | 92 680      |

\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2023 (suite)

|  |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
|--|--|---|---|--|-----------------------------|-------------|
| Description  | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>SPDR S&amp;P 500 UCITS ETF</b>                                  |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Actifs financiers</b>   |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats de change à terme et Contrats à terme standardisés</b> |  |   |   |  |                             |             |
| Bank of Montreal   | 2 588 341  | -   | 2 588 341   | (359 006)  | -                           | - 2 229 335 |
| Goldman Sachs  | 1 151 747  | -   | 1 151 747   | -  | -                           | - 1 151 747 |
| HSBC Bank  | 2 586 234  | -   | 2 586 234   | -  | -                           | - 2 586 234 |
| Toronto Dominion Bank  | 2 590 670  | -   | 2 590 670   | -  | -                           | - 2 590 670 |
| Westpac Banking Corporation  | 2 586 900  | -   | 2 586 900   | -  | -                           | - 2 586 900 |

|                                   |   |   |  | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                              |             |
|-----------------------------------|---|---|--|--|------------------------------|-------------|
| Description                       | Montants bruts des passifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des passifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires remises | Montant net |
| <b>SPDR S&amp;P 500 UCITS ETF</b> |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Passifs financiers</b>         |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Contrats de change à terme</b> |   |   |  |  |                              |             |
| Bank of Montreal                  | (359 006)   | -   | (359 006)  | 359 006  | -                            | -           |
| Citibank                          | (82 656)  | -   | (82 656)   | -  | -                            | - (82 656)  |

|  |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
|--|--|---|---|--|-----------------------------|-------------|
| Description                                      | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>SPDR S&amp;P 500 Low Volatility UCITS ETF</b> |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Actifs financiers</b>                         |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>             |  |   |   |  |                             |             |
| Goldman Sachs                                    | 9 108  | -   | 9 108   | -  | -                           | 9 108       |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2023 (suite)

| SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
|--|--|---|---|--|-----------------------------|-------------|
| Description  | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>                                 |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>                     |  |   |   |  |                             |             |
| Goldman Sachs  | 49 444   | -   | 49 444  | -  | -                           | 49 444      |
| SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF             |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
| Description  | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>                                 |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>                     |  |   |   |  |                             |             |
| Goldman Sachs  | 463 626  | -   | 463 626   | -  | -                           | 463 626     |
| SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF           |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
| Description  | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>                                 |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>                     |  |   |   |  |                             |             |
| Goldman Sachs  | 219 473  | -   | 219 473   | -  | -                           | 219 473     |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2023 (suite)

| SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF                   |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
|--|--|---|---|--|-----------------------------|-------------|
| Description  | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>   |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>                               |  |   |   |  |                             |             |
| Goldman Sachs  | 26 673   | -   | 26 673  | -  | -                           | 26 673      |
| SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF                       |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
| Description  | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>   |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>                               |  |   |   |  |                             |             |
| Goldman Sachs  | 7 015  | -   | 7 015   | -  | -                           | 7 015       |
| SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF                       |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
| Description  | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>   |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats de change à terme et Contrats à terme standardisés</b> |  |   |   |  |                             |             |
| Bank of Montreal   | 1 456 624  | -   | 1 456 624   | (186 506)  | -                           | 1 270 118   |
| BNP Paribas  | 40 814   | -   | 40 814  | (40 814)   | -                           | -           |
| Goldman Sachs  | 290 237  | -   | 290 237   | -  | -                           | 290 237     |
| HSBC Bank  | 1 395 291  | -   | 1 395 291   | -  | -                           | 1 395 291   |
| Morgan Stanley   | 5 483  | -   | 5 483   | (5 483)  | -                           | -           |
| Toronto Dominion Bank  | 1 397 685  | -   | 1 397 685   | -  | -                           | 1 397 685   |
| Westpac Banking Corporation  | 1 395 650  | -   | 1 395 650   | -  | -                           | 1 395 650   |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2023 (suite)

| SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS |   |   |  | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                              |             |
|--|---|---|--|--|------------------------------|-------------|
| ETF                                      |   |   |  |  |                              |             |
| Description                              | Montants bruts des passifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des passifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires remises | Montant net |
| <b>Passifs financiers</b>                |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Contrats de change à terme</b>        |   |   |  |  |                              |             |
| Bank of Montreal                         | (186 506)   | -   | (186 506)  | 186 506  | -                            | -           |
| BNP Paribas                              | (554 056)   | -   | (554 056)  | 40 814   | -                            | (513 242)   |
| Citibank                                 | (31 875)  | -   | (31 875)   | -  | -                            | (31 875)    |
| Morgan Stanley                           | (142 022)   | -   | (142 022)  | 5 483  | -                            | (136 539)   |
| Standard Chartered Bank                  | (41 880)  | -   | (41 880)   | -  | -                            | (41 880)    |
| UBS AG                                   | (10 566)  | -   | (10 566)   | -  | -                            | (10 566)    |

Les tableaux suivants présentent les actifs et passifs financiers du Compartiment qui font l'objet de compensations, d'accords-cadres de compensation exécutoires ou d'accords similaires au 31 mars 2022 :

31 mars 2022

| SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
|---|--|---|---|--|-----------------------------|-------------|
| Description                               | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>                  |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats de change à terme</b>         |  |   |   |  |                             |             |
| Goldman Sachs                             | 93 412   | -   | 93 412  | (3 413)  | -                           | 89 999      |
| HSBC Bank                                 | 96 489   | -   | 96 489  | (3 934)  | -                           | 92 555      |
| Merrill Lynch International               | 91 787   | -   | 91 787  | (3 296)  | -                           | 88 491      |
| UBS AG                                    | 96 873   | -   | 96 873  | (3 113)  | -                           | 93 760      |
| Westpac Banking Corporation               | 8 762  | -   | 8 762   | -  | -                           | 8 762       |



## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2022 (suite)

|   |   |   |  | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                              |             |
|---|---|---|--|--|------------------------------|-------------|
| SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF |   |   |  |  |                              |             |
| Description                               | Montants bruts des passifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des passifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires remises | Montant net |
| <b>Passifs financiers</b>                 |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Contrats de change à terme</b>         |   |   |  |  |                              |             |
| Goldman Sachs                             | (3 413)   | -   | (3 413)  | 3 413  | -                            | -           |
| HSBC Bank                                 | (3 934)   | -   | (3 934)  | 3 934  | -                            | -           |
| Merrill Lynch International               | (3 296)   | -   | (3 296)  | 3 296  | -                            | -           |
| UBS AG                                    | (3 113)   | -   | (3 113)  | 3 113  | -                            | -           |

|  |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
|--|--|---|---|--|-----------------------------|-------------|
| SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF |  |   |   |  |                             |             |
| Description  | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>                             |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats de change à terme</b>                    |  |   |   |  |                             |             |
| Barclays Bank  | 552 275  | -   | 552 275   | (451 817)  | -                           | 100 458     |
| BNP Paribas  | 54 607   | -   | 54 607  | (54 607)   | -                           | -           |
| Goldman Sachs  | 31 370   | -   | 31 370  | (31 370)   | -                           | -           |
| HSBC Bank  | 16 660   | -   | 16 660  | (16 660)   | -                           | -           |
| JP Morgan Chase Bank                                 | 7 097  | -   | 7 097   | (7 097)  | -                           | -           |
| Merrill Lynch International                          | 585 291  | -   | 585 291   | (181 431)  | -                           | 403 860     |
| Standard Chartered Bank                              | 176 614  | -   | 176 614   | (176 614)  | -                           | -           |
| UBS AG   | 750 139  | -   | 750 139   | (279 500)  | -                           | 470 639     |
| Westpac Banking Corporation                          | 224 168  | -   | 224 168   | (224 168)  | -                           | -           |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

#### 31 mars 2022 (suite)

| SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF |   |   |  | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                              |             |
|--|---|---|--|--|------------------------------|-------------|
| Description  | Montants bruts des passifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des passifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires remises | Montant net |
| <b>Passifs financiers</b>                            |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Contrats de change à terme</b>                    |   |   |  |  |                              |             |
| Barclays Bank  | (451 817)   | -   | (451 817)  | 451 817  | -                            | -           |
| BNP Paribas  | (82 035)  | -   | (82 035)   | 54 607   | -                            | (27 428)    |
| Citibank   | (82 042)  | -   | (82 042)   | -  | -                            | (82 042)    |
| Goldman Sachs  | (3 795 976)   | -   | (3 795 976)  | 31 370   | 2 970 000                    | (794 606)   |
| HSBC Bank  | (443 517)   | -   | (443 517)  | 16 660   | -                            | (426 857)   |
| JP Morgan Chase Bank                                 | (212 904)   | -   | (212 904)  | 7 097  | -                            | (205 807)   |
| Merrill Lynch International                          | (181 431)   | -   | (181 431)  | 181 431  | 690 000                      | 690 000     |
| Royal Bank of Canada                                 | (413 417)   | -   | (413 417)  | -  | -                            | (413 417)   |
| Standard Chartered Bank                              | (363 223)   | -   | (363 223)  | 176 614  | 200 000                      | 13 391      |
| UBS AG   | (279 500)   | -   | (279 500)  | 279 500  | 740 000                      | 740 000     |
| Westpac Banking Corporation                          | (795 192)   | -   | (795 192)  | 224 168  | -                            | (571 024)   |

| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF  |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
|---|--|---|---|--|-----------------------------|-------------|
| Description                                     | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>                        |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats de change à terme et Titres TBA</b> |  |   |   |  |                             |             |
| Bank of America                                 | 3 695 545  | -   | 3 695 545   | -  | -                           | 3 695 545   |
| Barclays Bank                                   | 7 756 584  | -   | 7 756 584   | (1 470 836)  | -                           | 6 285 748   |
| BNP Paribas                                     | 877 548  | -   | 877 548   | (877 548)  | -                           | -           |
| Citibank  | 1 542 771  | -   | 1 542 771   | (41 393)   | -                           | 1 501 378   |
| Credit Suisse                                   | 945 942  | -   | 945 942   | -  | -                           | 945 942     |
| Goldman Sachs                                   | 5 352 386  | -   | 5 352 386   | (445 335)  | -                           | 4 907 051   |
| HSBC Bank                                       | 761 053  | -   | 761 053   | (330 668)  | -                           | 430 385     |
| JP Morgan Chase Bank                            | 2 214 779  | -   | 2 214 779   | (309 130)  | -                           | 1 905 649   |
| Merrill Lynch International                     | 4 884 524  | -   | 4 884 524   | (1 402 721)  | -                           | 3 481 803   |
| Morgan Stanley                                  | 5 781 841  | -   | 5 781 841   | -  | -                           | 5 781 841   |
| Royal Bank of Canada                            | 723 360  | -   | 723 360   | (334 483)  | -                           | 388 877     |
| UBS AG  | 934 279  | -   | 934 279   | (688 609)  | -                           | 245 670     |
| Westpac Banking Corporation                     | 1 126 891  | -   | 1 126 891   | (1 126 891)  | -                           | -           |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2022 (suite)

| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond<br>UCITS ETF |  | Montants connexes non<br>compensés dans l'État de la<br>situation financière |   |                           |                                    |                |
|---|--|--|---|---------------------------|------------------------------------|----------------|
| Description                                       | Montants bruts<br>des passifs<br>financiers<br>comptabilisés | Montants bruts<br>compensés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière  | Montants nets<br>des passifs<br>présentés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière | Instruments<br>financiers | Garanties<br>numéraires<br>remises | Montant<br>net |
| <b>Passifs financiers</b>                         |  |  |   |                           |                                    |                |
| <b>Contrats de change à terme et Titres TBA</b>   |  |  |   |                           |                                    |                |
| Barclays Bank                                     | (1 470 836)  | -  | (1 470 836)   | 1 470 836                 | -                                  | -              |
| BNP Paribas                                       | (1 207 656)  | -  | (1 207 656)   | 877 548                   | -                                  | (330 108)      |
| Citibank  | (41 393)   | -  | (41 393)  | 41 393                    | -                                  | -              |
| Goldman Sachs                                     | (445 335)  | -  | (445 335)   | 445 335                   | -                                  | -              |
| HSBC Bank   | (330 668)  | -  | (330 668)   | 330 668                   | -                                  | -              |
| JP Morgan Chase Bank                              | (309 130)  | -  | (309 130)   | 309 130                   | -                                  | -              |
| Merrill Lynch International                       | (1 402 721)  | -  | (1 402 721)   | 1 402 721                 | -                                  | -              |
| Royal Bank of Canada                              | (334 483)  | -  | (334 483)   | 334 483                   | -                                  | -              |
| UBS AG  | (688 609)  | -  | (688 609)   | 688 609                   | -                                  | -              |
| Westpac Banking Corporation                       | (1 153 441)  | -  | (1 153 441)   | 1 126 891                 | -                                  | (26 550)       |

| SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG<br>UCITS ETF |   | Montants connexes non<br>compensés dans l'État de la<br>situation financière |  |                           |                                   |                |
|---|---|--|--|---------------------------|-----------------------------------|----------------|
| Description   | Montants bruts<br>des actifs<br>financiers<br>comptabilisés | Montants bruts<br>compensés<br>dans l'État de la<br>situation<br>financière  | Montants nets<br>des actifs<br>présentés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière | Instruments<br>financiers | Garanties<br>numéraires<br>reçues | Montant<br>net |
| <b>Actifs financiers</b>                            |   |  |  |                           |                                   |                |
| <b>Contrats de change à terme</b>                   |   |  |  |                           |                                   |                |
| Barclays Bank                                       | 173 021   | -  | 173 021  | (173 021)                 | -                                 | -              |
| BNP Paribas   | 672   | -  | 672  | -                         | -                                 | 672            |
| Goldman Sachs                                       | 693   | -  | 693  | (693)                     | -                                 | -              |
| JP Morgan Chase Bank                                | 79  | -  | 79   | -                         | -                                 | 79             |
| Merrill Lynch International                         | 175 566   | -  | 175 566  | (175 566)                 | -                                 | -              |
| UBS AG  | 163 191   | -  | 163 191  | (163 191)                 | -                                 | -              |
| Westpac Banking Corporation                         | 243 881   | -  | 243 881  | (243 881)                 | -                                 | -              |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

#### 31 mars 2022 (suite)

| SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |  |                        |                              |             |
|--|---|--|--|------------------------|------------------------------|-------------|
| Description                                      | Montants bruts des passifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière        | Montants nets des passifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers | Garanties numéraires remises | Montant net |
| <b>Passifs financiers</b>                        |   |  |  |                        |                              |             |
| <b>Contrats de change à terme</b>                |   |  |  |                        |                              |             |
| Barclays Bank                                    | (173 634)   | -  | (173 634)  | 173 021                | -                            | (613)       |
| Goldman Sachs                                    | (260 993)   | -  | (260 993)  | 693                    | -                            | (260 300)   |
| HSBC Bank  | (269 360)   | -  | (269 360)  | -                      | -                            | (269 360)   |
| Merrill Lynch International                      | (180 534)   | -  | (180 534)  | 175 566                | -                            | (4 968)     |
| Royal Bank of Canada                             | (251 079)   | -  | (251 079)  | -                      | -                            | (251 079)   |
| UBS AG   | (163 252)   | -  | (163 252)  | 163 191                | -                            | (61)        |
| Westpac Banking Corporation                      | (433 910)   | -  | (433 910)  | 243 881                | -                            | (190 029)   |

| SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF |  | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |   |                        |                             |             |
|---|--|--|---|------------------------|-----------------------------|-------------|
| Description   | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière        | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>                                    |  |  |   |                        |                             |             |
| <b>Contrats de change à terme</b>                           |  |  |   |                        |                             |             |
| Bank of Montreal  | 762  | -  | 762   | -                      | -                           | 762         |
| Barclays Bank   | 767  | -  | 767   | -                      | -                           | 767         |
| HSBC Bank   | 763  | -  | 763   | -                      | -                           | 763         |
| Royal Bank of Canada  | 763  | -  | 763   | -                      | -                           | 763         |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2022 (suite)

| SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF                        |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
|--|--|---|---|--|-----------------------------|-------------|
| Description  | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>   |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>                               |  |   |   |  |                             |             |
| Goldman Sachs  | 161 244  | -   | 161 244   | -  | -                           | 161 244     |
| SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF                                 |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
| Description  | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>   |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>                               |  |   |   |  |                             |             |
| Goldman Sachs  | 579 359  | -   | 579 359   | -  | -                           | 579 359     |
| SPDR MSCI ACWI UCITS ETF   |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
| Description  | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>   |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats de change à terme et Contrats à terme standardisés</b> |  |   |   |  |                             |             |
| Barclays Bank  | 1 055 605  | -   | 1 055 605   | (87 368)   | -                           | 968 237     |
| BNP Paribas  | 172 957  | -   | 172 957   | (172 957)  | -                           | -           |
| Citibank   | 12 260   | -   | 12 260  | (12 260)   | -                           | -           |
| JP Morgan Chase Bank   | 2 144  | -   | 2 144   | (2 144)  | -                           | -           |
| Merrill Lynch International  | 40 167   | -   | 40 167  | -  | -                           | 40 167      |
| Royal Bank of Canada   | 172 723  | -   | 172 723   | (172 723)  | -                           | -           |
| UBS AG   | 132 631  | -   | 132 631   | (132 631)  | -                           | -           |
| Westpac Banking Corporation  | 1 239 491  | -   | 1 239 491   | (203 452)  | -                           | 1 036 039   |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

##### Risque de contrepartie (suite)

#### 31 mars 2022 (suite)

| SPDR MSCI ACWI UCITS ETF          |   |   |  |                        |                              |             | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |  |
|-----------------------------------|---|---|--|------------------------|------------------------------|-------------|--|--|
| Description                       | Montants bruts des passifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des passifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers | Garanties numéraires remises | Montant net |  |  |
| <b>Passifs financiers</b>         |   |   |  |                        |                              |             |  |  |
| <b>Contrats de change à terme</b> |   |   |  |                        |                              |             |  |  |
| Barclays Bank                     | (87 368)  | -   | (87 368)   | 87 368                 | -                            | -           |  |  |
| BNP Paribas                       | (684 124)   | -   | (684 124)  | 172 957                | -                            | (511 167)   |  |  |
| Citibank                          | (56 926)  | -   | (56 926)   | 12 260                 | -                            | (44 666)    |  |  |
| Goldman Sachs                     | (3 905)   | -   | (3 905)  | -                      | -                            | (3 905)     |  |  |
| HSBC Bank                         | (69 824)  | -   | (69 824)   | -                      | -                            | (69 824)    |  |  |
| JP Morgan Chase Bank              | (770 162)   | -   | (770 162)  | 2 144                  | -                            | (768 018)   |  |  |
| Royal Bank of Canada              | (674 914)   | -   | (674 914)  | 172 723                | -                            | (502 191)   |  |  |
| UBS AG                            | (689 320)   | -   | (689 320)  | 132 631                | -                            | (556 689)   |  |  |
| Westpac Banking Corporation       | (203 452)   | -   | (203 452)  | 203 452                | -                            | -           |  |  |

| SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF          |  |   |   |                        |                             |             | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |  |
|--------------------------------------|--|---|---|------------------------|-----------------------------|-------------|--|--|
| Description                          | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers | Garanties numéraires reçues | Montant net |  |  |
| <b>Actifs financiers</b>             |  |   |   |                        |                             |             |  |  |
| <b>Contrats à terme standardisés</b> |  |   |   |                        |                             |             |  |  |
| Barclays Bank                        | 109 710  | -   | 109 710   | -                      | -                           | 109 710     |  |  |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

#### 31 mars 2022 (suite)

|  |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
|--|--|---|---|--|-----------------------------|-------------|
| Description  | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>SPDR MSCI EMU UCITS ETF</b>                                     |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Actifs financiers</b>   |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>                               |  |   |   |  |                             |             |
| Goldman Sachs  | 12 914   | -   | 12 914  | -  | -                           | 12 914      |
|  |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
| <b>SPDR MSCI Japan UCITS ETF</b>                                   |  |   |   |  |                             |             |
| Description  | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>   |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats de change à terme et Contrats à terme standardisés</b> |  |   |   |  |                             |             |
| Barclays Bank  | 20 915 253   | -   | 20 915 253  | -  | -                           | 20 915 253  |
| Citibank   | 20 174 125   | -   | 20 174 125  | -  | -                           | 20 174 125  |
| Goldman Sachs  | 14 782 500   | -   | 14 782 500  | -  | -                           | 14 782 500  |
| Morgan Stanley   | 1 200 082  | -   | 1 200 082   | (1 200 082)  | -                           | -           |
| Royal Bank of Canada   | 20 893 104   | -   | 20 893 104  | -  | -                           | 20 893 104  |
| UBS AG   | 1 445 615  | -   | 1 445 615   | -  | -                           | 1 445 615   |
| Westpac Banking Corporation  | 21 710 401   | -   | 21 710 401  | -  | -                           | 21 710 401  |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2022 (suite)

|  |   |   |  | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                              |             |
|--|---|---|--|--|------------------------------|-------------|
| Description                                    | Montants bruts des passifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des passifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires remises | Montant net |
| <b>SPDR MSCI Japan UCITS ETF</b>               |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Passifs financiers</b>                      |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Contrats de change à terme</b>              |   |   |  |  |                              |             |
| Merrill Lynch International                    | (2 452 648)   | -   | (2 452 648)  | -  | -                            | (2 452 648) |
| Morgan Stanley                                 | (3 463 473)   | -   | (3 463 473)  | 1 200 082  | -                            | (2 263 391) |
|  |   |   |  | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                              |             |
| <b>SPDR MSCI World UCITS ETF</b>               |   |   |  |  |                              |             |
| Description                                    | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés  | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière  | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues  | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>                       |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>           |   |   |  |  |                              |             |
| Barclays Bank                                  | 405 538   | -   | 405 538  | -  | -                            | 405 538     |
|  |   |   |  | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                              |             |
| <b>SPDR S&amp;P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF</b> |   |   |  |  |                              |             |
| Description                                    | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés  | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière  | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues  | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>                       |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>           |   |   |  |  |                              |             |
| Goldman Sachs                                  | 53 815  | -   | 53 815   | -  | -                            | 53 815      |



## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

#### 31 mars 2022 (suite)

| Description                                    | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
|--|--|---|---|--|-----------------------------|-------------|
|  |  |   |   | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>SPDR S&amp;P 500 ESG Leaders UCITS ETF*</b> |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Actifs financiers</b>                       |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>           |  |   |   |  |                             |             |
| Goldman Sachs                                  | 82 850   | -   | 82 850  | -  | -                           | 82 850      |

\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

| Description  | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
|--|--|---|---|--|-----------------------------|-------------|
|  |  |   |   | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>SPDR S&amp;P 500 UCITS ETF</b>                                  |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Actifs financiers</b>   |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats de change à terme et Contrats à terme standardisés</b> |  |   |   |  |                             |             |
| Bank of Montreal   | 10 612   | -   | 10 612  | (10 612)   | -                           | -           |
| Barclays Bank  | 17 093   | -   | 17 093  | -  | -                           | 17 093      |
| Goldman Sachs  | 420 565  | -   | 420 565   | (49 304)   | -                           | 371 261     |
| JP Morgan Chase Bank   | 232 460  | -   | 232 460   | -  | -                           | 232 460     |
| Morgan Stanley   | 85 904   | -   | 85 904  | -  | -                           | 85 904      |
| Westpac Banking Corporation  | 297 003  | -   | 297 003   | (297 003)  | -                           | -           |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2022 (suite)

|                                   |   |   |  | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                              |             |
|-----------------------------------|---|---|--|--|------------------------------|-------------|
| <b>SPDR S&amp;P 500 UCITS ETF</b> |   |   |  |  |                              |             |
| Description                       | Montants bruts des passifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des passifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires remises | Montant net |
| <b>Passifs financiers</b>         |   |   |  |  |                              |             |
| <b>Contrats de change à terme</b> |   |   |  |  |                              |             |
| Bank of Montreal                  | (1 261 686)   | -   | (1 261 686)  | 10 612   | -                            | (1 251 074) |
| Citibank                          | (1 251 856)   | -   | (1 251 856)  | -  | -                            | (1 251 856) |
| Goldman Sachs                     | (49 304)  | -   | (49 304)   | 49 304   | -                            | -           |
| HSBC Bank                         | (1 239 438)   | -   | (1 239 438)  | -  | -                            | (1 239 438) |
| UBS AG                            | (161 849)   | -   | (161 849)  | -  | -                            | (161 849)   |
| Westpac Banking Corporation       | (1 257 547)   | -   | (1 257 547)  | 297 003  | -                            | (960 544)   |

|  |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
|--|--|---|---|--|-----------------------------|-------------|
| <b>SPDR S&amp;P 500 Low Volatility UCITS ETF</b> |  |   |   |  |                             |             |
| Description                                      | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>                         |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>             |  |   |   |  |                             |             |
| Goldman Sachs                                    | 13 841   | -   | 13 841  | -  | -                           | 13 841      |

|   |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
|---|--|---|---|--|-----------------------------|-------------|
| <b>SPDR S&amp;P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF</b> |  |   |   |  |                             |             |
| Description   | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>  |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>                                |  |   |   |  |                             |             |
| Goldman Sachs   | 51 900   | -   | 51 900  | -  | -                           | 51 900      |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2022 (suite)

| SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF     |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
|--|--|---|---|--|-----------------------------|-------------|
| Description                                      | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>                         |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>             |  |   |   |  |                             |             |
| Goldman Sachs                                    | 161 217  | -   | 161 217   | -  | -                           | 161 217     |
| SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF   |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
| Description                                      | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>                         |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>             |  |   |   |  |                             |             |
| Goldman Sachs                                    | 429 091  | -   | 429 091   | -  | -                           | 429 091     |
| SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF |  |   |   | Montants connexes non compensés dans l'État de la situation financière |                             |             |
| Description                                      | Montants bruts des actifs financiers comptabilisés | Montants bruts compensés dans l'État de la situation financière | Montants nets des actifs présentés dans l'État de la situation financière | Instruments financiers   | Garanties numéraires reçues | Montant net |
| <b>Actifs financiers</b>                         |  |   |   |  |                             |             |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>             |  |   |   |  |                             |             |
| Goldman Sachs                                    | 41 357   | -   | 41 357  | -  | -                           | 41 357      |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

#### Risque de contrepartie (suite)

#### 31 mars 2022 (suite)

| SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS<br>ETF |   |   |  | Montants connexes non<br>compensés dans l'État de la<br>situation financière |                                   |                |
|---|---|---|--|--|-----------------------------------|----------------|
| Description                                     | Montants bruts<br>des actifs<br>financiers<br>comptabilisés | Montants bruts<br>compensés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière | Montants nets<br>des actifs<br>présentés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière | Instruments<br>financiers  | Garanties<br>numéraires<br>reçues | Montant<br>net |
| <b>Actifs financiers</b>                        |   |   |  |  |                                   |                |
| <b>Contrats à terme standardisés</b>            |   |   |  |  |                                   |                |
| Goldman Sachs                                   | 52 816  | -   | 52 816   | -  | -                                 | 52 816         |

| SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS<br>ETF                    |   |   |  | Montants connexes non<br>compensés dans l'État de la<br>situation financière |                                   |                |
|--|---|---|--|--|-----------------------------------|----------------|
| Description  | Montants bruts<br>des actifs<br>financiers<br>comptabilisés | Montants bruts<br>compensés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière | Montants nets<br>des actifs<br>présentés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière | Instruments<br>financiers  | Garanties<br>numéraires<br>reçues | Montant<br>net |
| <b>Actifs financiers</b>   |   |   |  |  |                                   |                |
| <b>Contrats de change à terme et Contrats à terme standardisés</b> |   |   |  |  |                                   |                |
| Goldman Sachs  | 524 963   | -   | 524 963  | -  | -                                 | 524 963        |
| HSBC Bank  | 137 252   | -   | 137 252  | (137 252)  | -                                 | -              |
| Morgan Stanley   | 21 088  | -   | 21 088   | (3 124)  | -                                 | 17 964         |
| UBS AG   | 144 492   | -   | 144 492  | -  | -                                 | 144 492        |
| Westpac Banking Corporation  | 137 317   | -   | 137 317  | (137 317)  | -                                 | -              |

| SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS<br>ETF |  |   |   | Montants connexes non<br>compensés dans l'État de la<br>situation financière |                                    |                |
|---|--|---|---|--|------------------------------------|----------------|
| Description                                     | Montants bruts<br>des passifs<br>financiers<br>comptabilisés | Montants bruts<br>compensés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière | Montants nets<br>des passifs<br>présentés dans<br>l'État de la<br>situation<br>financière | Instruments<br>financiers  | Garanties<br>numéraires<br>remises | Montant<br>net |
| <b>Passifs financiers</b>                       |  |   |   |  |                                    |                |
| <b>Contrats de change à terme</b>               |  |   |   |  |                                    |                |
| Bank of Montreal                                | (271 011)  | .   | (271 011)   | -  | -                                  | (271 011)      |
| Citibank  | (257 762)  | .   | (257 762)   | -  | -                                  | (257 762)      |
| HSBC Bank                                       | (255 205)  | .   | (255 205)   | 137 252  | -                                  | (117 953)      |
| Morgan Stanley                                  | (3 124)  | .   | (3 124)   | 3 124  | -                                  | -              |
| Westpac Banking Corporation                     | (258 934)  | .   | (258 934)   | 137 317  | -                                  | (121 617)      |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

Risque de contrepartie (suite)

#### 31 mars 2022 (suite)

Les titres de qualité *investment grade* sont ceux émis par une entité ayant obtenu au minimum une notation de qualité *investment grade* auprès d'au moins une agence de notation reconnue au niveau mondial ; Standard & Poor's ou Moody's.

Dans les tableaux suivants, les investissements notés BBB- et plus sont considérés de qualité *investment grade* et tous les investissements inférieurs à BBB- sont considérés de qualité *non investment grade*.

Les notations de crédit des émetteurs de titres détenus par les divers Compartiments sont les suivantes :

#### 31 mars 2023

| SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF | Total                | %             |
|---|----------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>                             | <b>EUR</b>           |               |
| <i>Investment grade</i>                               | 1 760 602 227        | 99,45         |
| <i>Non-investment grade</i>                           | 9 712 427            | 0,55          |
|   | <u>1 770 314 654</u> | <u>100,00</u> |

| SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF | Total              | %             |
|---|--------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>                             | <b>USD</b>         |               |
| <i>Investment grade</i>                               | 178 293 236        | 99,02         |
| <i>Non-investment grade</i>                           | 1 756 175          | 0,98          |
|   | <u>180 049 411</u> | <u>100,00</u> |

| SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF | Total              | %             |
|---|--------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>                 | <b>USD</b>         |               |
| <i>Investment grade</i>                   | 275 310 071        | 100,00        |
|   | <u>275 310 071</u> | <u>100,00</u> |

| SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF | Total              | %             |
|--|--------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>                              | <b>EUR</b>         |               |
| <i>Investment grade</i>                                | 618 527 263        | 99,72         |
| <i>Non-investment grade</i>                            | 1 743 589          | 0,28          |
|  | <u>620 270 852</u> | <u>100,00</u> |

| SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF | Total             | %             |
|--|-------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>                            | <b>USD</b>        |               |
| <i>Investment grade</i>                              | 94 418 076        | 100,00        |
|  | <u>94 418 076</u> | <u>100,00</u> |

| SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF | Total              | %             |
|--|--------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>                              | <b>USD</b>         |               |
| <i>Investment grade</i>                                | 156 601 157        | 98,26         |
| <i>Non-investment grade</i>                            | 2 767 426          | 1,74          |
|  | <u>159 368 583</u> | <u>100,00</u> |

| SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF | Total                | %             |
|--|----------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>                            | <b>USD</b>           |               |
| <i>Investment grade</i>                              | 2 097 917 198        | 82,18         |
| <i>Non-investment grade</i>                          | 455 023 207          | 17,82         |
|  | <u>2 552 940 405</u> | <u>100,00</u> |

| SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF | Total              | %             |
|--|--------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>                    | <b>EUR</b>         |               |
| <i>Investment grade</i>                      | 465 993 367        | 99,79         |
| <i>Non-investment grade</i>                  | 985 847            | 0,21          |
|  | <u>466 979 214</u> | <u>100,00</u> |

| SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF | Total                | %             |
|---|----------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>                     | <b>EUR</b>           |               |
| <i>Investment grade</i>                       | 1 027 904 221        | 99,85         |
| <i>Non-investment grade</i>                   | 1 498 046            | 0,15          |
|   | <u>1 029 402 267</u> | <u>100,00</u> |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2023 (suite)

#### SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF

|                             | Total              | %             |
|-----------------------------|--------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>   | <b>EUR</b>         |               |
| <i>Investment grade</i>     | 47 376 279         | 11,18         |
| <i>Non-investment grade</i> | 376 416 427        | 88,82         |
|                             | <u>423 792 706</u> | <u>100,00</u> |

#### SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

|                             | Total                | %             |
|-----------------------------|----------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>   | <b>USD</b>           |               |
| <i>Investment grade</i>     | 2 591 262 066        | 99,66         |
| <i>Non-investment grade</i> | 8 448 848            | 0,33          |
| Non noté                    | 292 509              | 0,01          |
|                             | <u>2 600 003 423</u> | <u>100,00</u> |

#### SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF

|                           | Total              | %             |
|---------------------------|--------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b> | <b>USD</b>         |               |
| <i>Investment grade</i>   | 354 226 129        | 100,00        |
|                           | <u>354 226 129</u> | <u>100,00</u> |

#### SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF

|                           | Total              | %             |
|---------------------------|--------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b> | <b>USD</b>         |               |
| <i>Investment grade</i>   | 485 619 522        | 100,00        |
|                           | <u>485 619 522</u> | <u>100,00</u> |

#### SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF

|                           | Total             | %             |
|---------------------------|-------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b> | <b>USD</b>        |               |
| <i>Investment grade</i>   | 19 550 072        | 100,00        |
|                           | <u>19 550 072</u> | <u>100,00</u> |

#### SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF

|                             | Total             | %             |
|-----------------------------|-------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>   | <b>EUR</b>        |               |
| <i>Investment grade</i>     | 72 081 820        | 99,66         |
| <i>Non-investment grade</i> | 246 476           | 0,34          |
|                             | <u>72 328 296</u> | <u>100,00</u> |

#### SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

|                             | Total                | %             |
|-----------------------------|----------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>   | <b>USD</b>           |               |
| <i>Investment grade</i>     | 6 726 353 829        | 99,80         |
| <i>Non-investment grade</i> | 13 289 026           | 0,20          |
|                             | <u>6 739 642 855</u> | <u>100,00</u> |

#### SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

|                             | Total              | %             |
|-----------------------------|--------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>   | <b>USD</b>         |               |
| <i>Investment grade</i>     | 21 066 729         | 11,18         |
| <i>Non-investment grade</i> | 167 344 932        | 88,82         |
|                             | <u>188 411 661</u> | <u>100,00</u> |

31 mars 2022

#### SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

|                             | Total                | %             |
|-----------------------------|----------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>   | <b>EUR</b>           |               |
| <i>Investment grade</i>     | 1 726 317 555        | 99,58         |
| <i>Non-investment grade</i> | 7 206 416            | 0,42          |
|                             | <u>1 733 523 971</u> | <u>100,00</u> |

#### SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

|                             | Total              | %             |
|-----------------------------|--------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>   | <b>USD</b>         |               |
| <i>Investment grade</i>     | 122 949 776        | 99,01         |
| <i>Non-investment grade</i> | 1 235 534          | 0,99          |
|                             | <u>124 185 310</u> | <u>100,00</u> |

#### SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF

|                           | Total              | %             |
|---------------------------|--------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b> | <b>USD</b>         |               |
| <i>Investment grade</i>   | 114 590 737        | 100,00        |
|                           | <u>114 590 737</u> | <u>100,00</u> |

#### SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF

|                             | Total              | %             |
|-----------------------------|--------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>   | <b>EUR</b>         |               |
| <i>Investment grade</i>     | 702 715 252        | 99,83         |
| <i>Non-investment grade</i> | 1 205 682          | 0,17          |
|                             | <u>703 920 934</u> | <u>100,00</u> |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2022 (suite)

#### SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

|                           | Total              | %             |
|---------------------------|--------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b> | <b>USD</b>         |               |
| <i>Investment grade</i>   | 138 681 839        | 100,00        |
|                           | <u>138 681 839</u> | <u>100,00</u> |

#### SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

|                             | Total             | %             |
|-----------------------------|-------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>   | <b>USD</b>        |               |
| <i>Investment grade</i>     | 69 033 820        | 98,97         |
| <i>Non-investment grade</i> | 719 260           | 1,03          |
|                             | <u>69 753 080</u> | <u>100,00</u> |

#### SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

|                             | Total                | %             |
|-----------------------------|----------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>   | <b>USD</b>           |               |
| <i>Investment grade</i>     | 2 400 662 207        | 81,29         |
| <i>Non-investment grade</i> | 552 506 865          | 18,71         |
|                             | <u>2 953 169 072</u> | <u>100,00</u> |

#### SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

|                             | Total              | %             |
|-----------------------------|--------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>   | <b>EUR</b>         |               |
| <i>Investment grade</i>     | 537 359 349        | 99,73         |
| <i>Non-investment grade</i> | 1 474 718          | 0,27          |
|                             | <u>538 834 067</u> | <u>100,00</u> |

#### SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

|                             | Total                | %             |
|-----------------------------|----------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>   | <b>EUR</b>           |               |
| <i>Investment grade</i>     | 1 088 259 003        | 99,83         |
| <i>Non-investment grade</i> | 1 882 175            | 0,17          |
|                             | <u>1 090 141 178</u> | <u>100,00</u> |

| SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF | Total              | %             |
|---|--------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>                     | <b>EUR</b>         |               |
| <i>Investment grade</i>                       | 37 207 385         | 6,79          |
| <i>Non-investment grade</i>                   | 510 627 780        | 93,21         |
|   | <u>547 835 165</u> | <u>100,00</u> |

| SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF | Total                | %             |
|--|----------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>                      | <b>USD</b>           |               |
| <i>Investment grade</i>                        | 1 870 577 356        | 99,75         |
| <i>Non-investment grade</i>                    | 4 579 437            | 0,24          |
| Non noté                                       | 120 272              | 0,01          |
|  | <u>1 875 277 065</u> | <u>100,00</u> |

| SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF | Total              | %             |
|---|--------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>                   | <b>USD</b>         |               |
| <i>Investment grade</i>                     | 519 152 862        | 100,00        |
|   | <u>519 152 862</u> | <u>100,00</u> |

| SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF | Total             | %             |
|--|-------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>                    | <b>USD</b>        |               |
| <i>Investment grade</i>                      | 29 743 630        | 100,00        |
|  | <u>29 743 630</u> | <u>100,00</u> |

| SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF | Total             | %             |
|--|-------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>                        | <b>EUR</b>        |               |
| <i>Investment grade</i>                          | 69 441 245        | 99,71         |
| <i>Non-investment grade</i>                      | 199 625           | 0,29          |
|  | <u>69 640 870</u> | <u>100,00</u> |

| SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF | Total                | %             |
|--|----------------------|---------------|
| <b>Notation de crédit</b>                        | <b>USD</b>           |               |
| <i>Investment grade</i>                          | 6 831 714 399        | 99,84         |
| <i>Non-investment grade</i>                      | 10 985 473           | 0,16          |
|  | <u>6 842 699 872</u> | <u>100,00</u> |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de crédit (suite)

Risque de contrepartie (suite)

31 mars 2022 (suite)

| SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield<br>Corporate ESG UCITS ETF | Total                     | %                    |
|--|---------------------------|----------------------|
| <b>Notation de crédit</b>                                      | <b>USD</b>                |                      |
| Investment grade   | 9 005 933                 | 6,66                 |
| Non-investment grade   | <u>126 281 424</u>        | <u>93,34</u>         |
|  | <b><u>135 287 357</u></b> | <b><u>100,00</u></b> |

#### Risque de liquidité

Le risque de liquidité correspond au risque qu'un Compartiment ne puisse générer suffisamment de ressources en numéraire pour régler intégralement ses obligations lorsqu'elles parviennent à échéance, ou que le règlement de ses obligations soit effectué à des conditions particulièrement désavantageuses. Tout Compartiment peut être exposé au règlement quotidien d'appels de marge pour des dérivés et à des rachats en numéraire quotidiens d'actions rachetables.

Les Compartiments ont la possibilité d'emprunter à court terme pour garantir les règlements. Chaque Compartiment peut emprunter des fonds auprès d'une banque dans la limite de 10 % de sa VL, mais seulement de manière temporaire. Le dispositif relève des taux d'intérêt des fonds fédéraux, majorés de 200 points de base.

Certains investissements et types d'investissements sont soumis à des restrictions sur la revente, peuvent être négociés sur des marchés de gré à gré ou en volumes limités, ou peuvent ne pas présenter de marché de négociation actif. Des titres illiquides peuvent être négociés avec une décote par rapport à des investissements comparables plus liquides et être soumis à de fortes fluctuations de leur valeur de marché. Il peut s'avérer difficile pour un Compartiment d'évaluer de manière exacte des titres illiquides. Un Compartiment peut aussi ne pas pouvoir céder des titres illiquides ou exécuter ou conclure facilement une transaction sur dérivés à un moment ou à un prix favorable ou à des prix approchant ceux auxquels le Compartiment les évalue actuellement.

#### Limites de rachat

Si les ordres de rachat reçus concernant les Actions d'un Compartiment particulier un Jour de négociation donné atteignent un total cumulé de plus de 10 % de toutes les Actions émises dudit Compartiment ce Jour de négociation, la Société de gestion sera en droit, à son entière discrétion, de refuser de racheter le nombre d'Actions de ce Compartiment dépassant, ledit Jour de négociation, 10 % des Actions émises du Compartiment pour les demandes de rachat reçues, si la Société de gestion le juge pertinent. Si la Société de gestion refuse de racheter les Actions pour ce motif, les requêtes de rachat présentées pour ladite date seront diminuées au prorata et les Actions soumises à requête et non rachetées le seront chaque Jour de négociation suivant (sans être traitées en priorité ledit Jour de négociation suivant), sous réserve que la Société ne soit pas tenue de racheter plus de 10 % du nombre d'Actions d'un Compartiment particulier en souffrance un Jour de négociation donné, jusqu'à ce que toutes les Actions du Compartiment concernées par la requête initiale aient été rachetées.

#### Rachat d'actions en nature

Chaque Compartiment permettra aux investisseurs de souscrire des Actions en nature durant tout Jour de négociation, sauf indication contraire dans le Supplément correspondant. Dans ce contexte, « en nature » signifie que, moyennant le consentement de l'Actionnaire, au lieu d'effectuer des versements en numéraire pour un rachat, la Société livrera des titres ou une combinaison de numéraire et de titres, sous réserve que l'allocation entre ces actifs soit soumise à l'approbation du Dépositaire. Les demandes de rachat doivent être reçues par l'Agent administratif avant l'heure limite de négociation du Jour de négociation concerné. Lorsqu'un Actionnaire demande le rachat d'Actions d'un Compartiment représentant 5 % ou plus de la Valeur liquidative, la Société de gestion peut déterminer à son entière discrétion de réaliser un rachat en nature. Les actifs à transférer seront sélectionnés à la discrétion de la Société de gestion et soumis à l'approbation du Dépositaire et pris à leur valeur utilisée pour déterminer le prix des Actions à racheter. Dans ce cas, la Société de gestion, si nécessaire, vendra les actifs pour le compte de l'Actionnaire aux frais de celui-ci et



## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 11. RISQUES FINANCIERS (SUITE)

#### Risque de liquidité (suite)

##### *Rachat d'Actions en nature (suite)*

le paiera en espèces. Ce type de distributions n'entraînera pas de préjudice important pour les autres Actionnaires. Le coût de ce type de cession sera pris en charge par l'Actionnaire remboursable.

##### *Suspension temporaire des transactions*

Les Administrateurs pourront à tout moment, après notification préalable au Dépositaire, suspendre temporairement l'émission, la valorisation, la vente, l'achat, le rachat ou la conversion des Actions d'un Compartiment, ou le paiement des produits de rachat, durant :

a) toute période durant laquelle un Marché reconnu sur lequel une part substantielle des investissements compris dans la Société sont cotés ou négociés est fermé (pour des raisons autres que les jours fériés ordinaires) ou suspendu ;

b) toute période où, en raison d'événements politiques, militaires, économiques ou monétaires ou d'autres circonstances échappant au contrôle, à la responsabilité et au pouvoir des Administrateurs, la cession ou l'évaluation des investissements sont affectées ;

c) toute coupure des moyens de communication normalement utilisés pour déterminer la valeur des investissements qui doit être constatée rapidement ou avec précision ;

d) toute période durant laquelle la Société n'est pas en mesure de rapatrier des fonds en vue d'effectuer des remboursements ou pendant laquelle la réalisation des investissements est effectuée à des prix ou à des taux de change normaux ;

e) toute période durant laquelle, en raison de conditions de marché défavorables, le paiement des produits de rachat peut, de l'avis des Administrateurs, se révéler préjudiciable à la Société ou les autres Actionnaires dans la Société ; et

f) toute période durant laquelle les Administrateurs décident qu'il est dans le meilleur intérêt des Actionnaires de procéder ainsi.

Les passifs financiers de chaque Compartiment comprennent les moins-values latentes sur contrats de change à terme, les montants à payer pour les investissements achetés, les distributions payables, les contrats à terme standardisés, les découverts bancaires, les actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables, le capital-actions et les charges à payer. Tous ont une maturité inférieure à six mois au 31 mars 2023 et au 31 mars 2022.

#### Exposition globale

Selon la Réglementation OPCVM, et dans le cadre des exigences liées à la gestion du risque et au reporting, l'exposition globale des Compartiments doit être contrôlée et évaluée conformément aux exigences réglementaires. Conformément aux exigences réglementaires, l'exposition globale peut être calculée selon deux méthodes, soit :

- i) l'Approche d'engagement qui calcule l'exposition cumulée générée par les instruments détenus par les Compartiments ; ou
- ii) la méthode de la Valeur à Risque (« VaR ») quand des stratégies d'investissement complexes sont utilisées. La mesure de la VaR estime la perte potentielle du portefeuille durant une période prédéfinie selon un niveau de confiance spécifié. La méthode de la VaR est une mesure statistique donnant un résultat unique agrégé pour l'ensemble du portefeuille, en tenant compte des volatilités de tous les marchés et tous les actifs et de leurs corrélations en permettant des compensations entre les différents actifs et marchés.

Les Compartiments utilisent l'approche d'engagement pour mesurer l'exposition globale.

### 12. HIÉRARCHIE DES JUSTES VALEURS

#### Hiérarchie des justes valeurs

La Norme IFRS 7 exige que les sociétés classent les évaluations à la juste valeur en utilisant une hiérarchie des justes valeurs reflétant l'importance des données d'entrée utilisées pour effectuer les évaluations.

La hiérarchie des justes valeurs comprend les niveaux suivants définis par la Norme IFRS 7 :

Niveau 1 - Prix cotés (non ajustés) sur des marchés actifs pour des actifs ou passifs identiques.

Niveau 2 – Données d'entrée autres que les prix cotés inclus dans le Niveau 1 observables pour l'actif ou le passif, directement (comme des prix) ou indirectement (dérivées de prix).

Niveau 3 – Données d'entrée pour l'actif ou le passif non fondées sur des données de marché observables (données d'entrée non observables).

De plus, pour les instruments présentant un nombre important de données d'entrée non observables (Niveau 3), la Norme IFRS 13 exige de fournir des informations concernant les transferts vers et depuis le Niveau 3, une réconciliation des soldes initiaux et de clôture, les plus-values et moins-values totales pour l'exercice réparties parmi celles figurant dans l'État du résultat global, les acquisitions, les problèmes liés aux ventes et les règlements, et une analyse de sensibilité des hypothèses utilisées pour déterminer la juste valeur des positions de Niveau 3.

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 12. HIÉRARCHIE DES JUSTES VALEURS (SUITE)

Le niveau de la hiérarchie des justes valeurs utilisé pour catégoriser la mesure de la juste valeur dans son intégralité est déterminé à partir du niveau le plus bas d'une donnée qui soit significatif pour l'évaluation de la juste valeur dans son intégralité. À cette fin, l'importance d'une donnée d'entrée est évaluée par rapport à l'évaluation de la juste valeur dans son intégralité. Lorsqu'une mesure de juste valeur est fondée sur des données observables qui requièrent un ajustement significatif sur la base de données non observables, cette mesure relève alors du Niveau 3. Déterminer l'importance d'une donnée d'entrée particulière pour l'évaluation de la juste valeur dans son intégralité nécessite un jugement tenant compte des facteurs spécifiques à l'actif ou au passif.

La détermination du caractère « observable » nécessite que la Société fasse preuve de jugement. La Société considère les données observables comme des données de marché immédiatement disponibles, diffusées ou actualisées régulièrement, fiables et vérifiables, non exclusives et fournies par des sources indépendantes activement impliquées sur le marché concerné.

S'agissant de chaque catégorie d'actifs et de passifs qui ne sont pas évalués à la juste valeur dans l'État de la situation financière, mais pour laquelle la juste valeur est publiée, la Norme IFRS 13 exige de la Société qu'elle publie le niveau de la hiérarchie des justes valeurs dans lequel la mesure de la juste valeur peut être classée ainsi qu'une description de la technique d'évaluation et des données utilisées par cette technique. Les actifs et les passifs qui ne sont pas comptabilisés à la juste valeur sont comptabilisés aux coûts amortis, et leurs valeurs comptables sont une approximation raisonnable de la juste valeur.

La trésorerie et les équivalents de trésorerie, ainsi que les liquidités détenues en tant que garanties auprès des courtiers sont classés au Niveau 1.

Tous les soldes à recevoir et à payer sont classés au Niveau 2.

Les tableaux suivants analysent, dans le cadre de la hiérarchie des justes valeurs, les actifs et passifs financiers de la Société mesurés à la juste valeur au 31 mars 2023 et au 31 mars 2022.

31 mars 2023

#### SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>EUR        | Niveau 2<br>EUR | Niveau 3<br>EUR        | Total<br>EUR |
|--|------------------------|-----------------|------------------------|--------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                        |                 |                        |              |
| Obligations  | - 1 770 314 654        |                 | - 1 770 314 654        |              |
|  | <b>- 1 770 314 654</b> |                 | <b>- 1 770 314 654</b> |              |

#### SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD      | Total<br>USD |
|--|----------------------|-----------------|----------------------|--------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                 |                      |              |
| Obligations  | - 180 049 411        |                 | - 180 049 411        |              |
|  | <b>- 180 049 411</b> |                 | <b>- 180 049 411</b> |              |

#### SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF

|   | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD      | Total<br>USD |
|---|----------------------|-----------------|----------------------|--------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :  |                      |                 |                      |              |
| Obligations   | - 275 310 071        |                 | - 275 310 071        |              |
| Contrats de change à terme  | - 319 957            |                 | - 319 957            |              |
|   | <b>- 275 630 028</b> |                 | <b>- 275 630 028</b> |              |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                 |                      |              |
| Contrats de change à terme  | - (26 737)           |                 | - (26 737)           |              |
|   | <b>- (26 737)</b>    |                 | <b>- (26 737)</b>    |              |

#### SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>EUR      | Niveau 2<br>EUR | Niveau 3<br>EUR      | Total<br>EUR |
|--|----------------------|-----------------|----------------------|--------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                 |                      |              |
| Obligations  | - 620 270 852        |                 | - 620 270 852        |              |
|  | <b>- 620 270 852</b> |                 | <b>- 620 270 852</b> |              |

#### SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD     | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD     | Total<br>USD |
|--|---------------------|-----------------|---------------------|--------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                     |                 |                     |              |
| Obligations  | - 94 418 076        |                 | - 94 418 076        |              |
|  | <b>- 94 418 076</b> |                 | <b>- 94 418 076</b> |              |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 12. HIÉRARCHIE DES JUSTES VALEURS (SUITE)

31 mars 2023 (suite)

#### SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD      | Total<br>USD |
|--|----------------------|-----------------|----------------------|--------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                 |                      |              |
| Obligations  | - 159 368 583        |                 | - 159 368 583        |              |
|  | <b>- 159 368 583</b> |                 | <b>- 159 368 583</b> |              |

#### SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|--------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                 |                 |                 |              |
| Obligations  | - 2 552 940 405 |                 | - 2 552 940 405 |              |

|                            |                        |  |                        |  |
|----------------------------|------------------------|--|------------------------|--|
| Contrats de change à terme | - 6 323 103            |  | - 6 323 103            |  |
|                            | <b>- 2 559 263 508</b> |  | <b>- 2 559 263 508</b> |  |

Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :

|                            |                      |  |                      |  |
|----------------------------|----------------------|--|----------------------|--|
| Contrats de change à terme | - (1 086 087)        |  | - (1 086 087)        |  |
|                            | <b>- (1 086 087)</b> |  | <b>- (1 086 087)</b> |  |

#### SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>EUR      | Niveau 2<br>EUR | Niveau 3<br>EUR      | Total<br>EUR |
|--|----------------------|-----------------|----------------------|--------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                 |                      |              |
| Obligations  | - 466 979 214        |                 | - 466 979 214        |              |
|  | <b>- 466 979 214</b> |                 | <b>- 466 979 214</b> |              |

#### SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>EUR        | Niveau 2<br>EUR | Niveau 3<br>EUR        | Total<br>EUR |
|--|------------------------|-----------------|------------------------|--------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                        |                 |                        |              |
| Obligations  | - 1 029 402 267        |                 | - 1 029 402 267        |              |
|  | <b>- 1 029 402 267</b> |                 | <b>- 1 029 402 267</b> |              |

#### SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>EUR      | Niveau 2<br>EUR | Niveau 3<br>EUR      | Total<br>EUR |
|--|----------------------|-----------------|----------------------|--------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                 |                      |              |
| Obligations  | - 423 792 706        |                 | - 423 792 706        |              |
|  | <b>- 423 792 706</b> |                 | <b>- 423 792 706</b> |              |

#### SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD        | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD        | Total<br>USD |
|--|------------------------|-----------------|------------------------|--------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                        |                 |                        |              |
| Obligations  | - 2 600 003 423        |                 | - 2 600 003 423        |              |
| Contrats de change à terme   | - 25 139 055           |                 | - 25 139 055           |              |
| Titres TBA   | - 33 606 868           |                 | - 33 606 868           |              |
|  | <b>- 2 658 749 346</b> |                 | <b>- 2 658 749 346</b> |              |

Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :

|                            |                       |  |                       |  |
|----------------------------|-----------------------|--|-----------------------|--|
| Contrats de change à terme | - (15 971 218)        |  | - (15 971 218)        |  |
|                            | <b>- (15 971 218)</b> |  | <b>- (15 971 218)</b> |  |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 12. HIÉRARCHIE DES JUSTES VALEURS (SUITE)

31 mars 2023 (suite)

#### SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD      | Total<br>USD |
|--|----------------------|-----------------|----------------------|--------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                 |                      |              |
| Obligations  | - 354 226 129        |                 | - 354 226 129        |              |
|  | <b>- 354 226 129</b> |                 | <b>- 354 226 129</b> |              |

#### SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD      | Total<br>USD |
|--|----------------------|-----------------|----------------------|--------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                 |                      |              |
| Obligations  | - 485 619 522        |                 | - 485 619 522        |              |
|  | <b>- 485 619 522</b> |                 | <b>- 485 619 522</b> |              |

#### SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD     | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD     | Total<br>USD |
|--|---------------------|-----------------|---------------------|--------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                     |                 |                     |              |
| Obligations  | - 19 550 072        |                 | - 19 550 072        |              |
|  | <b>- 19 550 072</b> |                 | <b>- 19 550 072</b> |              |

#### SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>EUR     | Niveau 2<br>EUR | Niveau 3<br>EUR     | Total<br>EUR |
|--|---------------------|-----------------|---------------------|--------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                     |                 |                     |              |
| Obligations  | - 72 328 296        |                 | - 72 328 296        |              |
|  | <b>- 72 328 296</b> |                 | <b>- 72 328 296</b> |              |

#### SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD        | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD        | Total<br>USD |
|--|------------------------|-----------------|------------------------|--------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                        |                 |                        |              |
| Obligations  | - 6 739 642 855        |                 | - 6 739 642 855        |              |
| Contrats de change à terme   | - 8 381 976            |                 | - 8 381 976            |              |
|  | <b>- 6 748 024 831</b> |                 | <b>- 6 748 024 831</b> |              |

Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :

|                            |                    |  |                    |  |
|----------------------------|--------------------|--|--------------------|--|
| Contrats de change à terme | - (745 982)        |  | - (745 982)        |  |
|                            | <b>- (745 982)</b> |  | <b>- (745 982)</b> |  |

#### SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD      | Total<br>USD |
|--|----------------------|-----------------|----------------------|--------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                 |                      |              |
| Obligations  | - 188 411 661        |                 | - 188 411 661        |              |
| Contrats de change à terme   | - 1 636 126          |                 | - 1 636 126          |              |
|  | <b>- 190 047 787</b> |                 | <b>- 190 047 787</b> |              |

Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :

|                            |                    |  |                    |  |
|----------------------------|--------------------|--|--------------------|--|
| Contrats de change à terme | - (246 938)        |  | - (246 938)        |  |
|                            | <b>- (246 938)</b> |  | <b>- (246 938)</b> |  |

#### SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD    | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD      | Total<br>USD |
|--|--------------------|-----------------|----------------------|--------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                    |                 |                      |              |
| Actions*   | 251 721 799        |                 | - 251 721 799        |              |
| Contrats à terme standardisés  | 24 382             |                 | - 24 382             |              |
|  | <b>251 746 181</b> |                 | <b>- 251 746 181</b> |              |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 12. HIÉRARCHIE DES JUSTES VALEURS (SUITE)

31 mars 2023 (suite)

#### SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>EUR   | Niveau 2<br>EUR | Niveau 3<br>EUR | Total<br>EUR      |
|--|-------------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                   |                 |                 |                   |
| Actions*   | 33 845 760        | -               | -               | 33 845 760        |
|  | <b>33 845 760</b> | <b>-</b>        | <b>-</b>        | <b>33 845 760</b> |

#### SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>GBP    | Niveau 2<br>GBP | Niveau 3<br>GBP | Total<br>GBP       |
|--|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                    |                 |                 |                    |
| Actions*   | 633 184 973        | 77 069          | -               | 633 262 042        |
| Instruments de placement en actions                                      | 39 537 236         | -               | -               | 39 537 236         |
| Droits   | 94 590             | -               | -               | 94 590             |
| Contrats à terme standardisés  | 78 731             | -               | -               | 78 731             |
|  | <b>672 895 530</b> | <b>77 069</b>   | <b>-</b>        | <b>672 972 599</b> |

#### SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

|   | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD  | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD         |
|---|----------------------|------------------|-----------------|----------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :  |                      |                  |                 |                      |
| Actions*  | 2 621 805 224        | -                | 50 130          | 2 621 855 354        |
| Droits  | 236                  | -                | -               | 236                  |
| Contrats de change à terme  | -                    | 5 676 253        | -               | 5 676 253            |
| Contrats à terme standardisés   | 222 298              | -                | -               | 222 298              |
|   | <b>2 622 027 758</b> | <b>5 676 253</b> | <b>50 130</b>   | <b>2 627 754 141</b> |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                  |                 |                      |
| Contrats de change à terme  | -                    | (439 606)        | -               | (439 606)            |
|   | <b>-</b>             | <b>(439 606)</b> | <b>-</b>        | <b>(439 606)</b>     |

#### SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

|   | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD         |
|---|----------------------|-----------------|-----------------|----------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :  |                      |                 |                 |                      |
| Actions*  | 1 027 514 123        | -               | 152 215         | 1 027 666 338        |
| Contrats à terme standardisés   | 26 471               | -               | -               | 26 471               |
|   | <b>1 027 540 594</b> | <b>-</b>        | <b>152 215</b>  | <b>1 027 692 809</b> |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                 |                 |                      |
| Contrats à terme standardisés   | (5 670)              | -               | -               | (5 670)              |
|   | <b>(5 670)</b>       | <b>-</b>        | <b>-</b>        | <b>(5 670)</b>       |

#### SPDR MSCI EMU UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>EUR    | Niveau 2<br>EUR | Niveau 3<br>EUR | Total<br>EUR       |
|--|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                    |                 |                 |                    |
| Actions*   | 219 810 056        | -               | -               | 219 810 056        |
| Contrats à terme standardisés  | 4 560              | -               | -               | 4 560              |
|  | <b>219 814 616</b> | <b>-</b>        | <b>-</b>        | <b>219 814 616</b> |

#### SPDR MSCI Japan UCITS ETF

|   | Niveau 1<br>JPY       | Niveau 2<br>JPY    | Niveau 3<br>JPY | Total<br>JPY          |
|---|-----------------------|--------------------|-----------------|-----------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :  |                       |                    |                 |                       |
| Actions*  | 40 457 487 131        | -                  | -               | 40 457 487 131        |
| Contrats de change à terme  | -                     | 15 751 452         | -               | 15 751 452            |
| Contrats à terme standardisés   | 3 551 062             | -                  | -               | 3 551 062             |
|   | <b>40 461 038 193</b> | <b>15 751 452</b>  | <b>-</b>        | <b>40 476 789 645</b> |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                       |                    |                 |                       |
| Contrats de change à terme  | -                     | (2 150 158)        | -               | (2 150 158)           |
|   | <b>-</b>              | <b>(2 150 158)</b> | <b>-</b>        | <b>(2 150 158)</b>    |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 12. HIÉRARCHIE DES JUSTES VALEURS (SUITE)

31 mars 2023 (suite)

#### SPDR MSCI World UCITS ETF

|   | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD         |
|---|----------------------|-----------------|-----------------|----------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :  |                      |                 |                 |                      |
| Actions*  | 2 228 878 414        | -               | -               | 2 228 878 414        |
| Contrats à terme standardisés   | 336 710              | -               | -               | 336 710              |
|   | <b>2 229 215 124</b> | -               | -               | <b>2 229 215 124</b> |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                 |                 |                      |
| Contrats à terme standardisés   | (333)                | -               | -               | (333)                |
|   | <b>(333)</b>         | -               | -               | <b>(333)</b>         |

#### SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD         |
|--|----------------------|-----------------|-----------------|----------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                 |                 |                      |
| Actions*   | 1 636 106 902        | -               | -               | 1 636 106 902        |
| Contrats à terme standardisés  | 23 760               | -               | -               | 23 760               |
|  | <b>1 636 130 662</b> | -               | -               | <b>1 636 130 662</b> |

#### SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF\*\*

|  | Niveau 1<br>USD    | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD       |
|--|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                    |                 |                 |                    |
| Actions*   | 748 655 366        | -               | -               | 748 655 366        |
| Contrats à terme standardisés  | 92 680             | -               | -               | 92 680             |
|  | <b>748 748 046</b> | -               | -               | <b>748 748 046</b> |

\*\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

#### SPDR S&P 500 UCITS ETF

|   | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD   | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD         |
|---|----------------------|-------------------|-----------------|----------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :  |                      |                   |                 |                      |
| Actions*  | 5 260 283 189        | -                 | -               | 5 260 283 189        |
| Contrats de change à terme  | -                    | 10 352 145        | -               | 10 352 145           |
| Contrats à terme standardisés   | 1 151 747            | -                 | -               | 1 151 747            |
|   | <b>5 261 434 936</b> | <b>10 352 145</b> | -               | <b>5 271 787 081</b> |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                   |                 |                      |
| Contrats de change à terme  | -                    | (441 662)         | -               | (441 662)            |
|   | -                    | <b>(441 662)</b>  | -               | <b>(441 662)</b>     |

#### SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD    | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD       |
|--|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                    |                 |                 |                    |
| Actions*   | 154 712 248        | -               | -               | 154 712 248        |
| Contrats à terme standardisés  | 9 108              | -               | -               | 9 108              |
|  | <b>154 721 356</b> | -               | -               | <b>154 721 356</b> |

#### SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD    | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD       |
|--|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                    |                 |                 |                    |
| Actions*   | 127 454 679        | -               | -               | 127 454 679        |
| Contrats à terme standardisés  | 49 444             | -               | -               | 49 444             |
|  | <b>127 504 123</b> | -               | -               | <b>127 504 123</b> |

#### SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>EUR      | Niveau 2<br>EUR | Niveau 3<br>EUR | Total<br>EUR         |
|--|----------------------|-----------------|-----------------|----------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                 |                 |                      |
| Actions*   | 1 207 219 538        | -               | -               | 1 207 219 538        |
| Contrats à terme standardisés  | 463 626              | -               | -               | 463 626              |
|  | <b>1 207 683 164</b> | -               | -               | <b>1 207 683 164</b> |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 12. HIÉRARCHIE DES JUSTES VALEURS (SUITE)

31 mars 2023 (suite)

|  | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD         |
|--|----------------------|-----------------|-----------------|----------------------|
| <b>SPDR S&amp;P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF</b>                |                      |                 |                 |                      |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                 |                 |                      |
| Actions*   | 1 177 281 048        | -               | -               | 1 177 281 048        |
| Contrats à terme standardisés  | 219 473              | -               | -               | 219 473              |
|  | <b>1 177 500 521</b> | -               | -               | <b>1 177 500 521</b> |

|  | Niveau 1<br>USD    | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD       |
|--|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| <b>SPDR S&amp;P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF</b>              |                    |                 |                 |                    |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                    |                 |                 |                    |
| Actions*   | 133 612 388        | -               | -               | 133 612 388        |
| Contrats à terme standardisés  | 26 673             | -               | -               | 26 673             |
|  | <b>133 639 061</b> | -               | -               | <b>133 639 061</b> |

|  | Niveau 1<br>GBP    | Niveau 2<br>GBP | Niveau 3<br>GBP | Total<br>GBP       |
|--|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| <b>SPDR S&amp;P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF</b>                  |                    |                 |                 |                    |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                    |                 |                 |                    |
| Actions*   | 123 860 115        | -               | -               | 123 860 115        |
| Contrats à terme standardisés  | 7 015              | -               | -               | 7 015              |
|  | <b>123 867 130</b> | -               | -               | <b>123 867 130</b> |

### SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF

|   | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD  | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD         |
|---|----------------------|------------------|-----------------|----------------------|
| <b>Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :</b> |                      |                  |                 |                      |
| Actions*  | 4 893 884 309        | -                | -               | 4 893 884 309        |
| <b>Contrats de change à terme</b>   |                      |                  |                 |                      |
| Contrats à terme standardisés   | 290 237              | -                | -               | 290 237              |
|   | <b>4 894 174 546</b> | <b>5 691 547</b> | -               | <b>4 899 866 093</b> |

Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :

|                                   |   |                  |   |                  |
|-----------------------------------|---|------------------|---|------------------|
| <b>Contrats de change à terme</b> |   |                  |   |                  |
|                                   | - | (966 905)        | - | (966 905)        |
|                                   | - | <b>(966 905)</b> | - | <b>(966 905)</b> |

\* Aux fins des tableaux ci-dessus, le terme « actions » inclut les actions ordinaires, les certificats représentatifs de titres, les fiducies d'investissement immobilier de type REIT et les actions préférentielles.

Les tableaux suivants analysent dans le cadre de la hiérarchie des justes valeurs les actifs et passifs financiers de la Société mesurés à la juste valeur au 31 mars 2022.

31 mars 2022

### SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF

|   | Niveau 1<br>EUR        | Niveau 2<br>EUR | Niveau 3<br>EUR | Total<br>EUR           |
|---|------------------------|-----------------|-----------------|------------------------|
| <b>Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :</b> |                        |                 |                 |                        |
| Obligations   | - 1 733 523 971        | -               | -               | - 1 733 523 971        |
|   | <b>- 1 733 523 971</b> | -               | -               | <b>- 1 733 523 971</b> |

### SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

|   | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD         |
|---|----------------------|-----------------|-----------------|----------------------|
| <b>Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :</b> |                      |                 |                 |                      |
| Obligations   | - 124 185 310        | -               | -               | - 124 185 310        |
|   | <b>- 124 185 310</b> | -               | -               | <b>- 124 185 310</b> |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 12. HIÉRARCHIE DES JUSTES VALEURS (SUITE)

31 mars 2022 (suite)

| SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF                                 |          |                    |          |                    |
|---|----------|--------------------|----------|--------------------|
|   | Niveau 1 | Niveau 2           | Niveau 3 | Total              |
|   | USD      | USD                | USD      | USD                |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :  |          |                    |          |                    |
| Obligations   | -        | 114 590 737        | -        | 114 590 737        |
| Contrats de change à terme  | -        | 387 323            | -        | 387 323            |
|   | -        | <b>114 978 060</b> | -        | <b>114 978 060</b> |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |          |                    |          |                    |
| Contrats de change à terme  | -        | (13 756)           | -        | (13 756)           |
|   | -        | <b>(13 756)</b>    | -        | <b>(13 756)</b>    |

| SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF                   |          |                    |          |                    |
|--|----------|--------------------|----------|--------------------|
|  | Niveau 1 | Niveau 2           | Niveau 3 | Total              |
|  | EUR      | EUR                | EUR      | EUR                |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |          |                    |          |                    |
| Obligations  | -        | 703 920 934        | -        | 703 920 934        |
|  | -        | <b>703 920 934</b> | -        | <b>703 920 934</b> |

| SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF                     |          |                    |          |                    |
|--|----------|--------------------|----------|--------------------|
|  | Niveau 1 | Niveau 2           | Niveau 3 | Total              |
|  | USD      | USD                | USD      | USD                |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |          |                    |          |                    |
| Obligations  | -        | 138 681 839        | -        | 138 681 839        |
|  | -        | <b>138 681 839</b> | -        | <b>138 681 839</b> |

### SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF

|  | Niveau 1 | Niveau 2          | Niveau 3 | Total             |
|--|----------|-------------------|----------|-------------------|
|  | USD      | USD               | USD      | USD               |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |          |                   |          |                   |
| Obligations  | -        | 69 753 080        | -        | 69 753 080        |
|  | -        | <b>69 753 080</b> | -        | <b>69 753 080</b> |

### SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF

|  | Niveau 1 | Niveau 2             | Niveau 3 | Total                |
|--|----------|----------------------|----------|----------------------|
|  | USD      | USD                  | USD      | USD                  |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |          |                      |          |                      |
| Obligations  | -        | 2 953 169 072        | -        | 2 953 169 072        |
| Contrats de change à terme   | -        | 2 398 221            | -        | 2 398 221            |
|  | -        | <b>2 955 567 293</b> | -        | <b>2 955 567 293</b> |

|   |   |                    |   |                    |
|---|---|--------------------|---|--------------------|
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |   |                    |   |                    |
| Contrats de change à terme  | - | (7 101 054)        | - | (7 101 054)        |
|   | - | <b>(7 101 054)</b> | - | <b>(7 101 054)</b> |

### SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

|  | Niveau 1 | Niveau 2           | Niveau 3 | Total              |
|--|----------|--------------------|----------|--------------------|
|  | EUR      | EUR                | EUR      | EUR                |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |          |                    |          |                    |
| Obligations  | -        | 538 834 067        | -        | 538 834 067        |
|  | -        | <b>538 834 067</b> | -        | <b>538 834 067</b> |

### SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF

|  | Niveau 1 | Niveau 2             | Niveau 3 | Total                |
|--|----------|----------------------|----------|----------------------|
|  | EUR      | EUR                  | EUR      | EUR                  |
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |          |                      |          |                      |
| Obligations  | -        | 1 090 141 178        | -        | 1 090 141 178        |
|  | -        | <b>1 090 141 178</b> | -        | <b>1 090 141 178</b> |



## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 12. HIÉRARCHIE DES JUSTES VALEURS (SUITE)

31 mars 2022 (suite)

#### SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>EUR | Niveau 2<br>EUR    | Niveau 3<br>EUR | Total<br>EUR       |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                 |                    |                 |                    |
| Obligations  | -               | 547 835 165        | -               | 547 835 165        |
|  | -               | <b>547 835 165</b> | -               | <b>547 835 165</b> |

#### SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF

|   | Niveau 1<br>USD | Niveau 2<br>USD      | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD         |
|---|-----------------|----------------------|-----------------|----------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :  |                 |                      |                 |                      |
| Obligations   | -               | 1 875 277 065        | -               | 1 875 277 065        |
| Contrats de change à terme  | -               | 17 392 348           | -               | 17 392 348           |
| Titres TBA  | -               | 19 205 155           | -               | 19 205 155           |
|   | -               | <b>1 911 874 568</b> | -               | <b>1 911 874 568</b> |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                 |                      |                 |                      |
| Contrats de change à terme  | -               | (7 384 272)          | -               | (7 384 272)          |
|   | -               | <b>(7 384 272)</b>   | -               | <b>(7 384 272)</b>   |

#### SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD | Niveau 2<br>USD    | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD       |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                 |                    |                 |                    |
| Obligations  | -               | 415 415 184        | -               | 415 415 184        |
|  | -               | <b>415 415 184</b> | -               | <b>415 415 184</b> |

#### SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD | Niveau 2<br>USD    | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD       |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                 |                    |                 |                    |
| Obligations  | -               | 519 152 862        | -               | 519 152 862        |
|  | -               | <b>519 152 862</b> | -               | <b>519 152 862</b> |

#### SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD | Niveau 2<br>USD   | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD      |
|--|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                 |                   |                 |                   |
| Obligations  | -               | 29 743 630        | -               | 29 743 630        |
|  | -               | <b>29 743 630</b> | -               | <b>29 743 630</b> |

#### SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>EUR | Niveau 2<br>EUR   | Niveau 3<br>EUR | Total<br>EUR      |
|--|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                 |                   |                 |                   |
| Obligations  | -               | 69 640 870        | -               | 69 640 870        |
|  | -               | <b>69 640 870</b> | -               | <b>69 640 870</b> |

#### SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF

|   | Niveau 1<br>USD | Niveau 2<br>USD      | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD         |
|---|-----------------|----------------------|-----------------|----------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :  |                 |                      |                 |                      |
| Obligations   | -               | 6 842 699 872        | -               | 6 842 699 872        |
| Contrats de change à terme  | -               | 757 103              | -               | 757 103              |
|   | -               | <b>6 843 456 975</b> | -               | <b>6 843 456 975</b> |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                 |                      |                 |                      |
| Contrats de change à terme  | -               | (1 732 762)          | -               | (1 732 762)          |
|   | -               | <b>(1 732 762)</b>   | -               | <b>(1 732 762)</b>   |

#### SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD | Niveau 2<br>USD    | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD       |
|--|-----------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                 |                    |                 |                    |
| Obligations  | -               | 135 287 357        | -               | 135 287 357        |
| Contrats de change à terme   | -               | 3 055              | -               | 3 055              |
|  | -               | <b>135 290 412</b> | -               | <b>135 290 412</b> |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 12. HIÉRARCHIE DES JUSTES VALEURS (SUITE)

31 mars 2022 (suite)

#### SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD    | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD       |
|--|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                    |                 |                 |                    |
| Actions*   | 337 509 440        | -               | -               | 337 509 440        |
| Contrats à terme standardisés  | 161 244            | -               | -               | 161 244            |
|  | <b>337 670 684</b> | -               | -               | <b>337 670 684</b> |

#### SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>EUR   | Niveau 2<br>EUR | Niveau 3<br>EUR | Total<br>EUR      |
|--|-------------------|-----------------|-----------------|-------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                   |                 |                 |                   |
| Actions*   | 61 753 223        | -               | -               | 61 753 223        |
|  | <b>61 753 223</b> | -               | -               | <b>61 753 223</b> |

#### SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>GBP    | Niveau 2<br>GBP | Niveau 3<br>GBP | Total<br>GBP       |
|--|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                    |                 |                 |                    |
| Actions*   | 614 599 486        | -               | 71 256          | 614 670 742        |
| Instruments de placement en actions                                      | 43 523 123         | -               | -               | 43 523 123         |
| Contrats à terme standardisés  | 579 359            | -               | -               | 579 359            |
|  | <b>658 701 968</b> | -               | <b>71 256</b>   | <b>658 773 224</b> |

#### SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

|   | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD    | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD         |
|---|----------------------|--------------------|-----------------|----------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :  |                      |                    |                 |                      |
| Actions*  | 3 177 578 399        | 24 524             | 7               | 3 177 602 930        |
| Droits  | 17 253               | -                  | -               | 17 253               |
| Contrats de change à terme  | -                    | 1 100 166          | -               | 1 100 166            |
| Contrats à terme standardisés   | 631 297              | -                  | -               | 631 297              |
|   | <b>3 178 226 949</b> | <b>1 124 690</b>   | <b>7</b>        | <b>3 179 351 646</b> |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                    |                 |                      |
| Contrats de change à terme  | -                    | (2 143 480)        | -               | (2 143 480)          |
|   | -                    | <b>(2 143 480)</b> | -               | <b>(2 143 480)</b>   |

#### SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD         |
|--|----------------------|-----------------|-----------------|----------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                 |                 |                      |
| Actions*   | 1 136 620 841        | 83 707          | -               | 1 136 704 548        |
| Droits   | 33 969               | -               | -               | 33 969               |
| Contrats à terme standardisés  | 109 710              | -               | -               | 109 710              |
|  | <b>1 136 764 520</b> | <b>83 707</b>   | -               | <b>1 136 848 227</b> |

#### SPDR MSCI EMU UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>EUR    | Niveau 2<br>EUR | Niveau 3<br>EUR | Total<br>EUR       |
|--|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                    |                 |                 |                    |
| Actions*   | 229 153 707        | -               | 15              | 229 153 722        |
| Droits   | 8 010              | -               | -               | 8 010              |
| Contrats à terme standardisés  | 12 914             | -               | -               | 12 914             |
|  | <b>229 174 631</b> | -               | <b>15</b>       | <b>229 174 646</b> |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 12. HIÉRARCHIE DES JUSTES VALEURS (SUITE)

31 mars 2022 (suite)

#### SPDR MSCI Japan UCITS ETF

|   | Niveau 1<br>JPY       | Niveau 2<br>JPY      | Niveau 3<br>JPY         | Total<br>JPY       |
|---|-----------------------|----------------------|-------------------------|--------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :  |                       |                      |                         |                    |
| Actions*  | 32 719 968 598        | -                    | -                       | 32 719 968 598     |
| Contrats de change à terme  |                       | - 86 338 580         | -                       | 86 338 580         |
| Contrats à terme standardisés   | 14 782 500            | -                    | -                       | 14 782 500         |
|   | <b>32 734 751 098</b> | <b>86 338 580</b>    | <b>- 32 821 089 678</b> |                    |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                       |                      |                         |                    |
| Contrats de change à terme  |                       | - (5 916 121)        | -                       | (5 916 121)        |
|   |                       | <b>- (5 916 121)</b> | <b>-</b>                | <b>(5 916 121)</b> |

#### SPDR MSCI World UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD         |
|--|----------------------|-----------------|-----------------|----------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                 |                 |                      |
| Actions*   | 1 435 228 782        | -               | -               | 1 435 228 782        |
| Droits   | 5 593                | -               | -               | 5 593                |
| Contrats à terme standardisés  | 405 538              | -               | -               | 405 538              |
|  | <b>1 435 639 913</b> | <b>-</b>        | <b>-</b>        | <b>1 435 639 913</b> |

#### SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD         |
|--|----------------------|-----------------|-----------------|----------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                 |                 |                      |
| Actions*   | 1 342 566 801        | -               | -               | 1 342 566 801        |
| Contrats à terme standardisés  | 53 815               | -               | -               | 53 815               |
|  | <b>1 342 620 616</b> | <b>-</b>        | <b>-</b>        | <b>1 342 620 616</b> |

#### SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF\*\*

|  | Niveau 1<br>USD    | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD       |
|--|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                    |                 |                 |                    |
| Actions*   | 570 653 933        | -               | -               | 570 653 933        |
| Contrats à terme standardisés  | 82 850             | -               | -               | 82 850             |
|  | <b>570 736 783</b> | <b>-</b>        | <b>-</b>        | <b>570 736 783</b> |

\*\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

#### SPDR S&P 500 UCITS ETF

|   | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD      | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD         |
|---|----------------------|----------------------|-----------------|----------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :  |                      |                      |                 |                      |
| Actions*  | 6 391 683 241        | -                    | -               | 6 391 683 241        |
| Contrats de change à terme  |                      | 643 072              | -               | 643 072              |
| Contrats à terme standardisés   | 420 565              | -                    | -               | 420 565              |
|   | <b>6 392 103 806</b> | <b>643 072</b>       | <b>-</b>        | <b>6 392 746 878</b> |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                      |                 |                      |
| Contrats de change à terme  |                      | - (5 221 680)        | -               | (5 221 680)          |
|   |                      | <b>- (5 221 680)</b> | <b>-</b>        | <b>(5 221 680)</b>   |

#### SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD    | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD       |
|--|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                    |                 |                 |                    |
| Actions*   | 184 679 030        | -               | -               | 184 679 030        |
| Contrats à terme standardisés  | 13 841             | -               | -               | 13 841             |
|  | <b>184 692 871</b> | <b>-</b>        | <b>-</b>        | <b>184 692 871</b> |

#### SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD    | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD       |
|--|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                    |                 |                 |                    |
| Actions*   | 101 262 726        | -               | -               | 101 262 726        |
| Contrats à terme standardisés  | 51 900             | -               | -               | 51 900             |
|  | <b>101 314 626</b> | <b>-</b>        | <b>-</b>        | <b>101 314 626</b> |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 12. HIÉRARCHIE DES JUSTES VALEURS (SUITE)

31 mars 2022 (suite)

#### SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>EUR      | Niveau 2<br>EUR | Niveau 3<br>EUR | Total<br>EUR         |
|--|----------------------|-----------------|-----------------|----------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                 |                 |                      |
| Actions*   | 1 077 481 752        | -               | -               | 1 077 481 752        |
| Contrats à terme standardisés  | 161 217              | -               | -               | 161 217              |
|  | <b>1 077 642 969</b> | -               | -               | <b>1 077 642 969</b> |

#### SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD         |
|--|----------------------|-----------------|-----------------|----------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                 |                 |                      |
| Actions*   | 1 192 798 115        | -               | -               | 1 192 798 115        |
| Contrats à terme standardisés  | 429 091              | -               | -               | 429 091              |
|  | <b>1 193 227 206</b> | -               | -               | <b>1 193 227 206</b> |

#### SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>USD    | Niveau 2<br>USD | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD       |
|--|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                    |                 |                 |                    |
| Actions*   | 155 967 907        | -               | -               | 155 967 907        |
| Contrats à terme standardisés  | 41 357             | -               | -               | 41 357             |
|  | <b>156 009 264</b> | -               | -               | <b>156 009 264</b> |

#### SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF

|  | Niveau 1<br>GBP    | Niveau 2<br>GBP | Niveau 3<br>GBP | Total<br>GBP       |
|--|--------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                    |                 |                 |                    |
| Actions*   | 122 789 687        | -               | -               | 122 789 687        |
| Contrats à terme standardisés  | 52 816             | -               | -               | 52 816             |
|  | <b>122 842 503</b> | -               | -               | <b>122 842 503</b> |

#### SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF

|   | Niveau 1<br>USD      | Niveau 2<br>USD    | Niveau 3<br>USD | Total<br>USD         |
|---|----------------------|--------------------|-----------------|----------------------|
| Actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat :  |                      |                    |                 |                      |
| Actions*  | 3 918 482 532        | -                  | -               | 3 918 482 532        |
| Contrats de change à terme  | -                    | 440 149            | -               | 440 149              |
| Contrats à terme standardisés   | 524 963              | -                  | -               | 524 963              |
|   | <b>3 919 007 495</b> | <b>440 149</b>     | -               | <b>3 919 447 644</b> |
| Passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat : |                      |                    |                 |                      |
| Contrats de change à terme  | -                    | (1 046 036)        | -               | (1 046 036)          |
|   | -                    | <b>(1 046 036)</b> | -               | <b>(1 046 036)</b>   |

\* Aux fins des tableaux ci-dessus, le terme « actions » inclut les actions ordinaires, les certificats représentatifs de titres, les fiducies d'investissement immobilier de type REIT et les actions préférentielles.

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 12. HIÉRARCHIE DES JUSTES VALEURS (SUITE)

#### Rapprochement pour le Niveau 3

Le tableau suivant montre un rapprochement de toutes les variations de la juste valeur des instruments financiers classés dans le Niveau 3 pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 et l'exercice financier clôturé le 31 mars 2022.

#### SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF

|   | Total<br>31 mars<br>2023<br>USD | Total<br>31 mars<br>2022<br>USD |
|---|---------------------------------|---------------------------------|
| Solde à l'ouverture   | -                               | -                               |
| Plus-values et moins-values comptabilisées dans le compte de résultat   | 1 046                           | -                               |
| Achats  | -                               | -                               |
| Ventes  | (1 046)                         | -                               |
| Transferts depuis le Niveau 3   | -                               | -                               |
| Transferts vers le Niveau 3   | -                               | -                               |
| Solde à la clôture  | -                               | -                               |
| Total des plus-values ou moins-values latentes constatées dans l'État du résultat global correspondant aux actifs à la fin de la période considérée (inclus dans le poste « Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat ») | -                               | -                               |

#### SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF

|   | Total<br>31 mars<br>2023<br>USD | Total<br>31 mars<br>2022<br>USD |
|---|---------------------------------|---------------------------------|
| Solde à l'ouverture   | 71 256                          | -                               |
| Plus-values et moins-values comptabilisées dans le compte de résultat   | (71 256)                        | -                               |
| Achats  | -                               | -                               |
| Ventes  | -                               | -                               |
| Transferts depuis le Niveau 3   | -                               | -                               |
| Transferts vers le Niveau 3   | -                               | 71 256                          |
| Solde à la clôture  | -                               | 71 256                          |
| Total des plus-values ou moins-values latentes constatées dans l'État du résultat global correspondant aux actifs à la fin de la période considérée (inclus dans le poste « Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat ») | 71 256                          | -                               |

#### SPDR MSCI ACWI UCITS ETF

|   | Total<br>31 mars<br>2023<br>USD | Total<br>31 mars<br>2022<br>USD |
|---|---------------------------------|---------------------------------|
| Solde à l'ouverture   | 7                               | 7                               |
| Plus-values et moins-values comptabilisées dans le compte de résultat   | (1 762)                         | (9 224 735)                     |
| Achats  | 1 537 100                       | 9 329 692                       |
| Ventes  | (1 535 345)                     | (104 957)                       |
| Transferts depuis le Niveau 3   | -                               | -                               |
| Transferts vers le Niveau 3   | 50 130                          | -                               |
| Solde à la clôture  | 50 130                          | 7                               |
| Total des plus-values ou moins-values latentes constatées dans l'État du résultat global correspondant aux actifs à la fin de la période considérée (inclus dans le poste « Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat ») | (997 708)                       | -                               |

#### SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF

|   | Total<br>31 mars<br>2023<br>USD | Total<br>31 mars<br>2022<br>USD |
|---|---------------------------------|---------------------------------|
| Solde à l'ouverture   | -                               | -                               |
| Plus-values et moins-values comptabilisées dans le compte de résultat   | -                               | -                               |
| Achats  | -                               | -                               |
| Ventes  | -                               | -                               |
| Transferts depuis le Niveau 3   | -                               | -                               |
| Transferts vers le Niveau 3   | 152 215                         | -                               |
| Solde à la clôture  | 152 215                         | -                               |
| Total des plus-values ou moins-values latentes constatées dans l'État du résultat global correspondant aux actifs à la fin de la période de référence : - Incluses dans le poste « Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat » | -                               | -                               |

#### SPDR MSCI EMU UCITS ETF

|   | Total<br>31 mars<br>2023<br>EUR | Total<br>31 mars<br>2022<br>EUR |
|---|---------------------------------|---------------------------------|
| Solde à l'ouverture   | 15                              | 15                              |
| Plus-values et moins-values comptabilisées dans le compte de résultat   | (15)                            | -                               |
| Achats  | -                               | -                               |
| Ventes  | -                               | -                               |
| Transferts depuis le Niveau 3   | -                               | -                               |
| Transferts vers le Niveau 3   | -                               | -                               |
| Solde à la clôture  | -                               | 15                              |
| Total des plus-values ou moins-values latentes constatées dans l'État du résultat global correspondant aux actifs à la fin de la période considérée (inclus dans le poste « Variations nettes de la juste valeur des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat ») | -                               | -                               |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 12. HIÉRARCHIE DES JUSTES VALEURS (SUITE)

#### Rapprochement pour le Niveau 3 (suite)

Les titres de Niveau 3 sont généralement des titres de participation évalués à la juste valeur selon l'approche par les comparables. Pour les instruments évalués sur la base de données d'entrée non observables, la juste valeur est généralement décomptée par rapport au dernier prix observable, dans une fourchette comprise entre 0 et 100 %. La Société estime que ces valorisations étaient valables et qu'une évaluation d'alternatives raisonnablement possibles ne présenterait pas de différence significative.

Les investissements dont les valeurs sont établies sur les cours cotés sur des marchés actifs et qui relèvent ainsi du Niveau 1 comprennent les actions à cotation active, les droits, les bons de souscription et les dérivés négociés en Bourse. La Société n'ajuste pas le prix coté de ces instruments.

Les instruments financiers qui se négocient sur des marchés non considérés comme actifs, mais évalués sur la base des

cours de marché cotés, des cotations des courtiers ou de sources alternatives de valorisation à partir de données d'entrée observables sont classés dans le Niveau 2. Cela inclut les obligations et les produits dérivés négociés de gré à gré. Du fait que les investissements de Niveau 2 incluent des positions non négociées sur des marchés actifs et/ou soumises à des restrictions de transfert, les évaluations peuvent être ajustées pour refléter la liquidité ou la non-transférabilité, et sont généralement basées sur des données de marché disponibles.

Les investissements classés dans le Niveau 3 sont basés sur un nombre important de données non observables, compte tenu de la très faible fréquence des négociations.

Les transferts entre les niveaux de la hiérarchie des justes valeurs sont réputés être survenus à la fin de l'exercice financier. Aucun transfert n'a été effectué entre les niveaux au cours de la période de référence.

Les transferts entre les niveaux 1, 2 et 3 sont principalement dus à la disponibilité de cours du marché cotés, de cotations de courtiers ou de sources alternatives de valorisation soutenues par des données observables. Il n'y a pas eu d'autres transferts de titres entre les niveaux de la hiérarchie de la juste valeur.

#### 31 mars 2023

| Change<br>ment de<br>niveau | Compartiment                       | Titres                           |
|-----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|
| de 1 à 2                    | SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF | Home Reit PLC                    |
| de 1 à 3                    | SPDR MSCI ACWI UCITS ETF           | Shimao Group Holdings Ltd        |
|                             |                                    | Sunac China Holdings Ltd         |
|                             | SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF        | Shimao Group Holdings Ltd        |
|                             |                                    | Sunac China Holdings Ltd         |
| de 2 à 3                    | SPDR MSCI ACWI UCITS ETF           | Evergrande Health Industry Group |
|                             | SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF        | Evergrande Health Industry Group |
| de 1 à 2                    | SPDR MSCI ACWI UCITS ETF           | Evergrande Health Industry Group |
|                             | SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF        | Evergrande Health Industry Group |
|                             | SPDR MSCI EM UCITS ETF             | Evergrande Health Industry Group |
| de 1 à 3                    | SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF | Evraz                            |
|                             | SPDR MSCI ACWI UCITS ETF           | Magnit                           |
|                             |                                    | Mobile TeleSystems               |
|                             |                                    | Novatek                          |
|                             |                                    | TCS Group Holding                |
|                             |                                    | X5 Retail Group                  |
|                             | SPDR MSCI EM UCITS ETF             | Mobile TeleSystems               |

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 12. HIÉRARCHIE DES JUSTES VALEURS (SUITE)

#### Rapprochement pour le Niveau 3 (suite)

##### Sensibilité des actifs de Niveau 3 mesurée à la juste valeur par rapport aux variations des hypothèses

Le recours à des hypothèses alternatives raisonnablement possibles pour la valorisation des actifs de Niveau 3 peut résulter en l'estimation de la juste valeur et la recouvrabilité des actifs étant soumis à l'incertitude et un éventail de résultats possibles est probable. Ces différences, le cas échéant, peuvent avoir un effet important sur le portefeuille dans son ensemble au 31 mars 2023 ou au 31 mars 2022.

Si la valeur des titres de Niveau 3 augmentait/(diminuait) de 5 %, l'effet sur la VL au 31 mars 2023 serait comme suit :

- SPDR FTSE U.K. All Share UCITS : 0 GBP (31 mars 2022 : 3 563 GBP)

- SPDR MSCI ACWI UCITS : 2 507 USD (31 mars 2022 : 0 USD).

- SPDR MSCI EM Asia UCITS : 7 611 USD (31 mars 2022 : 0 USD).

### 13. INFORMATIONS SUR LES SECTEURS OPÉRATIONNELS

La Norme IFRS 8 Secteurs opérationnels (« Norme IFRS 8 ») exige une « approche de gestion » dans le cadre de laquelle les informations sur les secteurs sont présentées sur la même base que celle utilisée aux fins du reporting interne.

La Société de gestion est responsable de la gouvernance générale de la Société conformément au Prospectus. Les Administrateurs ont nommé State Street Global Advisors Europe Limited en tant que Société de gestion. State Street Global Advisors Limited est considéré comme le principal Décideur opérationnel aux fins de la Norme IFRS 8.

La Société de gestion réalise l'allocation stratégique des ressources pour le compte des Compartiments. La Société de gestion est responsable de l'ensemble du portefeuille de chaque Compartiment et considère chaque Compartiment comme un seul et même segment opérationnel. Les décisions de la Société de gestion en matière d'allocation d'actifs sont basées sur une stratégie d'investissement unique et intégrée, afin d'obtenir la performance de l'Indice de référence correspondant de chaque Compartiment, et la performance de chaque Compartiment est évaluée par rapport à l'Indice de référence correspondant.

Les Compartiments ne disposent pas d'actifs classés en actifs non circulants. Les investissements de chaque Compartiment exposent ce dernier à la performance de l'Indice de référence correspondant.

Les Compartiments disposent de portefeuilles hautement diversifiés, et aucun investissement ne représente une part significative du revenu de la Société.

#### Produits et services

Tous les revenus de la Société sont dérivés d'un regroupement de produits, en l'occurrence les titres et instruments dérivés du portefeuille dans lesquels les Compartiments ont investi pour répliquer les performances de leurs indices respectifs.

#### Régions géographiques

La Société ne supervise pas séparément les revenus des différentes régions géographiques. Toutefois, dans la mesure où les Compartiments répliquent des indices représentant des marchés spécifiques dans des régions spécifiques, les revenus de chaque Compartiment peuvent être considérés comme attribués à la région stipulée dans son objectif d'investissement.

#### Principaux clients

La Société est une société d'investissement et ses principaux clients directs sont les investisseurs institutionnels constituant le marché primaire pour les actions des Compartiments.

Les investissements sont répartis entre cinquante-cinq Compartiments distincts ayant chacun leur propre Tableau des investissements.

Le résultat financier et la situation financière de chaque segment correspondent aux états financiers de chaque Compartiment.

### 14. TAUX DE CHANGE

Les taux de change utilisés pour la conversion (le cas échéant) des soldes d'un Compartiment libellés dans des devises étrangères dans la devise de présentation de la Société, en USD, étaient les suivants à la fin de l'exercice financier :

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 14. TAUX DE CHANGE (SUITE)

|                                | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|--------------------------------|--------------|--------------|
|                                | USD          | USD          |
| Peso argentin                  | 208,99110    | -            |
| Dollar australien              | 1,49309      | 1,33165      |
| Réal brésilien                 | 5,07025      | 4,75195      |
| Livre sterling                 | 0,80877      | 0,75950      |
| Dollar canadien                | 1,35335      | 1,24905      |
| Peso chilien                   | 790,61000    | 786,92500    |
| Yuan Renminbi de Chine         | 6,87185      | 6,34310      |
| Yuan chinois offshore          | 6,86730      | 6,34810      |
| Peso colombien                 | 4 659,31000  | 3 753,70500  |
| Couronne tchèque               | 21,60890     | 21,95250     |
| Couronne danoise               | 6,85655      | 6,68535      |
| Livre égyptienne               | 30,80000     | 18,28000     |
| Euro                           | 0,92043      | 0,89876      |
| Dollar de Hong Kong            | 7,84995      | 7,83140      |
| Forint hongrois                | 350,08520    | 330,05890    |
| Roupie indienne                | 82,18250     | 75,77500     |
| Roupie indonésienne            | 14 994,50000 | 14 362,50000 |
| Nouveau shekel israélien       | 3,60065      | 3,19125      |
| Yen japonais                   | 133,09000    | 121,37500    |
| Dinar koweïtien                | 0,30685      | 0,30380      |
| Ringgit malais                 | 4,41250      | 4,20475      |
| Peso mexicain                  | 18,05600     | 19,94200     |
| Dirham marocain                | 10,22565     | 9,65505      |
| Nouveau dollar de Taiwan       | 30,44750     | 28,65150     |
| Dollar néo-zélandais           | 1,59834      | 1,43771      |
| Naira nigérian                 | 460,75000    | -            |
| Couronne norvégienne           | 10,47310     | 8,74400      |
| Roupie pakistanaise            | 283,87500    | 183,35000    |
| Sol péruvien                   | 3,76105      | 3,71500      |
| Peso philippin                 | 54,36500     | 51,74500     |
| Zloty polonais                 | 4,30805      | 4,16725      |
| Riyal qatari                   | 3,64000      | 3,64175      |
| Leu roumain                    | 4,55375      | 4,44160      |
| Rouble russe                   | 77,70000     | 82,35000     |
| Riyal saoudien                 | 3,75370      | 3,75150      |
| Dollar de Singapour            | 1,32955      | 1,35335      |
| Rand sud-africain              | 17,74250     | 14,61250     |
| Won sud-coréen                 | 1 301,85000  | 1 212,05000  |
| Couronne suédoise              | 10,36955     | 9,31940      |
| Franc suisse                   | 0,91355      | 0,92025      |
| Baht thaïlandais               | 34,19500     | 33,25000     |
| Lire turque                    | 19,19500     | 14,66775     |
| Dirham des Émirats arabes unis | 3,67250      | 3,67305      |

|                      | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|----------------------|--------------|--------------|
|                      | EUR          | EUR          |
| Livre sterling       | 0,87868      | 0,84506      |
| Couronne danoise     | 7,44930      | 7,43846      |
| Couronne norvégienne | 11,37850     | 9,72901      |
| Couronne suédoise    | 11,26600     | 10,36923     |
| Franc suisse         | 0,99253      | 1,02392      |
| Dollar américain     | 1,08645      | 1,11265      |

|                  | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|------------------|--------------|--------------|
|                  | GBP          | GBP          |
| Dollar canadien  | -            | 1,64456      |
| Euro             | 1,13806      | 1,18335      |
| Dollar américain | 1,23645      | 1,31665      |

|      | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|------|--------------|--------------|
|      | JPY          | JPY          |
| Euro | 0,00692      | 0,00740      |

Les taux de change moyens pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 et le 31 mars 2022 utilisés pour convertir (le cas échéant) la devise fonctionnelle d'un Compartiment dans la devise de présentation de la Société en USD, étaient les suivants :

|                | 31 mars 2023 | 31 mars 2022 |
|----------------|--------------|--------------|
| Livre sterling | 0,96150      | 0,73425      |
| Euro           | 0,83141      | 0,86318      |
| Yen japonais   | 135,87917    | 112,94792    |

### 15. ANNÉE COMPARATIVE

Les montants comparatifs figurant dans les présents états financiers concernent l'exercice clôturé au 31 mars 2022.

### 16. RAPPROCHEMENT AVEC LA VALEUR LIQUIDATIVE PUBLIÉE

Le Compartiment SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF peut être exposé aux actions brésiliennes et indiennes. Conformément aux Normes IFRS, le Compartiment est tenu de comptabiliser une provision pour d'éventuels impôts sur plus-values en tenant compte des positions ouvertes non reflétées dans la VL publiée à la fin de la période ou de l'exercice. Ces ajustements donnent lieu à la différence indiquée ci-dessous entre la VL par action reportée aux états financiers et la VL par action publiée.



## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 16. RAPPROCHEMENT AVEC LA VALEUR LIQUIDATIVE PUBLIÉE (SUITE)

| SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF  | 31 mars 2022         |
|--|----------------------|
| USD  |                      |
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables sur opérations conformément aux Normes IFRS | 1 029 820 170        |
| Majorés des ajustements aux fins de l'impôt sur les plus-values de capital   | 4 715 377            |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables publiés</b>                              | <b>1 034 535 547</b> |
| VL par action publiée conformément aux Normes IFRS   | 68,18                |
| <b>VL par action publiée</b>   | <b>68,49</b>         |

| SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF  | 31 mars 2022         |
|--|----------------------|
| USD  |                      |
| Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables sur opérations conformément aux Normes IFRS | 1 134 298 007        |
| Majorés des ajustements aux fins de l'impôt sur les plus-values de capital   | 6 526 168            |
| <b>Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables publiés</b>                              | <b>1 140 824 175</b> |
| VL par action publiée conformément aux Normes IFRS   | 75,62                |
| <b>VL par action publiée</b>   | <b>76,05</b>         |

### 17. ÉVÉNEMENTS SIGNIFICATIFS INTERVENUS DURANT L'EXERCICE FINANCIER

Un addenda au Prospectus a été approuvé par la BCI en date du 11 avril 2022. Cet addenda avait pour but d'informer les actionnaires qu'en raison de l'escalade de la situation géopolitique impliquant l'Ukraine et la Russie, une déclaration de risque supplémentaire concernant les sanctions imposées à la Russie avait été incluse dans le prospectus.

Le nom du Compartiment SPDR S&P 500 ESG Screened UCITS ETF a été remplacé par SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF à effet du 11 mai 2022. À la même date, l'indice du Compartiment est devenu l'indice S&P 500 ESG Leaders Index.

Les Compartiments suivants ont été révoqués par la Banque centrale d'Irlande le 12 mai 2022 :

- SPDR ICE BofA Emerging Markets Corporate Bond UCITS ETF
- SPDR Bloomberg U.S. Corporate Bond UCITS ETF

Les transactions en nature ont été suspendues pour un ensemble de compartiments à compter du 6 avril 2022. La liste des compartiments impactés par ce changement a été présentée dans un avis aux actionnaires publié le 23 mars 2022.

Ulla Pitha a démissionné en tant qu'Administratrice de la Société de gestion avec effet au 30 juin 2022.

Marie-Anne Heeren a été nommée Administratrice de la Société de gestion avec prise d'effet au 7 septembre 2022.

Patrick J. Riley et Tom Finlay ont démissionné de leurs fonctions d'Administrateurs de la Société avec prise d'effet au 16 mars 2023.

Jennifer Fox a été nommée Administratrice de la Société de gestion avec prise d'effet au 16 mars 2023.

Le Prospectus et les suppléments des Compartiments, soumis à la BCI pour approbation ont été mis à jour le 31 août 2022. De nombreuses modifications ont été apportées aux fins de la soumission du prospectus, y compris concernant l'actualisation des termes « Engagement actionnarial », « PIN » et « Taxinomie ». Concernant les suppléments, les mises à jour ont notamment porté sur un changement de stratégie de réplification de l'indice pour certains des compartiments et sur l'ajout d'un passage sur la dérogation aux limites d'investissement pour les autres.

## Notes aux états financiers pour l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023 (suite)

### 17. ÉVÉNEMENTS SIGNIFICATIFS INTERVENUS DURANT L'EXERCICE FINANCIER (SUITE)

Le Prospectus et les suppléments actualisés de la Société déposés le 31 août 2022 auprès de la BCI ont été approuvés le 28 octobre 2022.

La soumission rapide des informations à publier en vertu de l'Annexe II du SFDR eu égard aux Compartiments de l'entité relevant de l'Article 8 a été effectuée le 1<sup>er</sup> décembre 2022.

La catégorie SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond EUR Hdg UCITS ETF (Acc) a été lancée le 9 janvier 2023.

Le 9 mars 2023, les actions de Silicon Valley Bank Financial Group (ticker : SIVB) ont été suspendues sur le Nasdaq, suite aux retraits de fonds sur les dépôts et aux moins-values enregistrées par le titre avant que l'établissement financier en question ne passe sous le contrôle de la Federal Deposit Insurance Corporation (FDIC). La Société détenait des participations négligeables dans SIVB. La négociation de l'action ordinaire de SVB Bank a repris le 28 mars 2023 et les Compartiments qui détenaient des participations en portefeuille les ont vendues à cette date. La valorisation des obligations de SVB Bank s'est faite de manière ordonnée à compter du 9 mars 2023 et se maintient en phase avec les prix de marché.

Le 13 mars 2023, les actions de Signature Bank of New York (ticker : SBNY) ont été suspendues sur le Nasdaq, avant que l'établissement financier en question ne passe sous le contrôle de la Federal Deposit Insurance Corporation (FDIC). La Société détenait des participations négligeables dans SBNY. La négociation de l'action ordinaire de Signature Bank a repris le 28 mars 2023 et les Compartiments qui détenaient des participations en portefeuille les ont vendues à cette date.

Un accord de fusion entre Credit Suisse et UBS a été annoncé le 19 mars 2023 suite à l'intervention du Département fédéral des finances suisse, de la Banque Nationale suisse et de l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers suisse (« FINMA »). UBS sera l'entité survivante après la finalisation de l'opération. La FINMA a annoncé qu'elle avait décidé de réduire la valeur des obligations AT1 de Crédit Suisse à zéro. La Société ne détenait aucune obligation AT1 et n'avait que des participations négligeables dans des titres de sociétés affiliées de Crédit Suisse.

#### Conflit russo-ukrainien

Le conflit entre la Russie et l'Ukraine, qui a débuté le 24 février 2022, a donné lieu à de nombreuses restrictions et perturbations impactant les valeurs mobilières et les marchés russes. Les effets de ces restrictions ont affecté et sont susceptibles d'affecter encore les Compartiments exposés aux marchés russes. Les menaces de sanctions ou celles déjà imposées à l'encontre de la Russie, d'entités russes ou de particuliers russes peuvent entraîner une perturbation de l'économie du pays, provoquer une volatilité sur d'autres marchés régionaux et mondiaux et avoir une incidence négative sur les performances de divers secteurs et industries, ainsi que sur les sociétés d'autres pays, ce qui pourrait générer un effet préjudiciable sur les performances d'un Compartiment, même si ce dernier n'a pas d'exposition directe aux titres d'émetteurs russes. En raison, à la fois, de l'imposition des sanctions, des

mesures de représailles du gouvernement russe et de l'impact que ces deux facteurs ont eu sur les marchés de titres russes, certains Compartiments ont eu recours à des procédures de valorisation approuvées par le Conseil d'administration de la Société pour certains titres russes dont la valeur pourrait, le cas échéant, avoir été estimée à zéro. Les compartiments détiennent des positions insignifiantes sur les titres russes. Les sanctions, ou la menace de nouvelles sanctions, voire de sanctions remaniées, pourraient également entraver la capacité d'un Compartiment à acheter, vendre, détenir, recevoir, livrer ou effectuer d'autres transactions sur certains titres ou autres instruments d'investissement concernés. Au 31 mars 2023, le Compartiment SPDR MSCI ACWI UCITS ETF détenait des titres russes et a par conséquent été impacté par les décisions prises au regard de sa juste valeur.

Aucun autre événement important n'a affecté la Société durant l'exercice financier.

### 18. ÉVÉNEMENTS SIGNIFICATIFS SURVENUS DEPUIS LA CLÔTURE DE L'EXERCICE FINANCIER

Ellen Needham a démissionné en tant qu'Administratrice de la Société avec prise d'effet au 1<sup>er</sup> mai 2023.

Le 1<sup>er</sup> mai 2023, les actions de First Republic Bank (ticker : FRC.N) ont été suspendues sur la NYSE après que l'établissement financier en question passe sous le contrôle de la Federal Deposit Insurance Corporation (FDIC). La Société détenait des participations négligeables dans FRC. L'action ordinaire de FRC Bank s'est seulement échangée hors côte à partir du 3 mai 2023, date où toutes les actions ordinaires de l'établissement financier ont été liquidées.

Tom Coghlan a été nommé Administrateur de la Société de gestion avec prise d'effet au 25 juillet 2023.

Aucun autre événement important n'a affecté la Société depuis la fin de l'exercice financier.

### 19. APPROBATION DES COMPTES

Les états financiers ont été approuvés par le Conseil d'administration le 24 juillet 2023.

## Annexe I – Politique de rémunération (non auditée)

### Rémunération

State Street Corporation (« SSC ») et ses filiales directes et indirectes (ci-après conjointement désignées avec State Street Corporation, « State Street ») appliquent une stratégie de compensation à l'échelle du groupe, laquelle inclut une politique de rémunération applicable à toutes les entités de State Street dans le monde. State Street Global Advisors Europe Limited (« SSGAEL ») est la Société de gestion, le Gestionnaire d'investissement et le Distributeur mondial de SPDR ETFs Europe I Plc et délègue certaines activités relatives à la gestion des investissements et à la gestion des risques à SSGA Limited, SSGA Singapour et SSGA Trust Company (« Gestionnaires d'investissement »). Comme les filiales de State Street, les Gestionnaires d'investissement sont entièrement intégrés dans la stratégie de compensation du groupe State Street et sont placés sous l'autorité de la structure de gouvernance mondiale et régionale de State Street, afin d'assurer le contrôle adéquat et pertinent des modalités de rémunération (en ce compris la conformité aux règles de rémunération correspondantes) au sein des entités affiliées au groupe State Street. En vertu de sa charte, consultable sur demande, le Comité des ressources humaines (« CRH ») de SSC supervise l'ensemble des régimes, politiques et programmes de rémunération de State Street auxquels participent les cadres dirigeants, ainsi que les régimes d'intéressement, de retraite, de prévoyance et d'attribution d'actions du groupe auxquels participent certains autres collaborateurs de SSC. Il s'assure également que les conventions de rémunération par intéressement soient en adéquation avec la sécurité financière et la viabilité de State Street, conformément aux dispositions réglementaires et aux orientations applicables. Le CRH autorise la dotation globale du Plan d'intéressement (« PI »). Le directeur général alloue les enveloppes de PI aux entités opérationnelles et aux services du groupe en fonction de divers facteurs, lesquels peuvent inclure la performance budgétaire, la réalisation d'objectifs clés et autres considérations. La dépense définitive et la dotation globale entre allocations immédiates et différées sont ensuite révisées par le CRH avant que le paiement soit effectué.

State Street a également constitué des Comités de rémunération distincts pour le Royaume-Uni et pour SSGAEL, avec les fonctions principales suivantes :

- examen de la politique de rémunération applicable aux employés, à la direction et au Personnel identifié des Gestionnaires d'investissement et superviser sa mise en œuvre ;
- supervision du respect de toute réglementation applicable en matière de rémunération ;
- examen et approbation des décisions de rémunération relatives au Personnel identifié et recommandations envisageables pour l'ajustement ex post du risque du Personnel identifié.

State Street applique une politique de rémunération à l'échelle mondiale appuyée sur une documentation révisée annuellement (et complétée de tout addenda pertinent par territoire ou par régime de réglementation), laquelle documentation renseigne la grille de rémunération existante de State Street. Cette politique est destinée à se conformer aux exigences réglementaires applicables en matière de rémunération, y compris, mais sans s'y limiter, celles contenues dans les directives CRD, OPCVM V et AIFM, et sera interprétée et administrée en conséquence. Les politiques et pratiques de rémunération de State Street s'appliquent à tous les collaborateurs du groupe State Street dans le monde (en ce compris, les Gestionnaires d'investissement). Les principes directeurs qui permettent d'aligner le système de rémunération de State Street sur la stratégie opérationnelle sont les suivants :

- nous privilégions la rémunération globale ;
- nous visons un Programme de rémunération globale d'une valeur totale annuelle qui rivalise avec nos homologues ;
- nous soutenons sans équivoque la parité salariale pour un travail de même valeur.
- le financement de notre Programme de rémunération globale est subordonné aux conditions de faisabilité et conçu pour s'adapter à la performance du groupe ;
- nous différencions la rémunération basée sur la performance ;
- nous alignons les intérêts des collaborateurs avec ceux des Actionnaires ;
- nos régimes de rémunération sont conçus pour être conformes à la réglementation en vigueur et aux orientations correspondantes, et impliquent de ne pas encourager à prendre des risques excessifs.

Au vu de notre processus d'appréciation structuré pour déterminer les enveloppes d'intéressement et les décisions d'allocations individuelles, de report des primes incitatives et de possibles ajustements *ex ante* et *ex post* comme les renoncements et les récupérations fiscales, notre système de rémunération est raisonnablement sensible au risque et corrèle les décisions et mesures courantes avec les critères de risque futurs.

State Street applique une politique de prime discrétionnaire et entièrement flexible (à savoir que le montant de la composante variable individuelle peut fluctuer de manière importante d'une année sur l'autre, en fonction de la performance et des autres facteurs susmentionnés, et peut même être réduit à zéro sur une année donnée). La politique de prime discrétionnaire est structurée de manière à équilibrer les composantes fixes et les composantes variables, mais inclut également des ratios de rémunération maximum spécifiques lorsque les réglementations locales le nécessitent. Un certain nombre de collaborateurs des services commerciaux participent aux Plans d'intéressement structurés, lesquels visent à ajuster la composante variable accordée aux participants des plans sur les revenus qu'ils génèrent, tout en tenant compte d'indicateurs de performance qualitative non financiers. Tous ces participants perçoivent une composante fixe de rémunération suffisamment élevée. La composante variable est attribuée à titre individuel sur la base de mesures quantitatives et qualitatives.

## Annexe I – Politique de rémunération (non auditée) (suite)

Montant total de la rémunération versée par le Gestionnaire d'investissement au titre de l'exercice clôturé le 31/03/2023<sup>1</sup>

|  |         |
|--|---------|
| Rémunération fixe (en milliers d'USD)                    | 183 233 |
| Rémunération variable (en milliers d'USD)                | 178 775 |
| Rémunération globale (en milliers d'USD)                 | 362 008 |
| Nombre de bénéficiaires                                  | 1 406   |
| Commission de performance directement versée par l'OPCVM | s/o     |

Montant total de la rémunération (en milliers d'USD)

|                                  |         |
|----------------------------------|---------|
| Direction de SSGAEL <sup>2</sup> | 226     |
| Personnel identifié              | 213 296 |

<sup>1</sup> Ces données sont basées sur la rémunération de l'ensemble du personnel de l'entité juridique des gestionnaires d'investissement, et indiquent le nombre de bénéficiaires.

<sup>2</sup> Représente la rémunération versée aux administrateurs indépendants (les Administrateurs de SSGAEL qui sont également employés du Gestionnaire d'investissement ne perçoivent pas de rémunération en leur qualité de membres du conseil d'administration).

Les détails relatifs aux modalités de rémunération de State Street, incluant notamment les informations sur le processus de prise de décision pour définir la politique de rémunération, ses caractéristiques fondamentales et la corrélation entre salaire et performance, sont publiés séparément dans la Déclaration de mandat de State Street sur le site [www.statestreet.com](http://www.statestreet.com) ainsi que sous la section sur la rémunération du Rapport UK Pillar 3 du Gestionnaire d'investissement à l'adresse <https://www.ssga.com/library-content/pdfs/global/ssgal-pillar-3-disclosure-2023.pdf>. Compte tenu de la stratégie globale de rémunération de State Street, les informations sur les critères qualitatifs de rémunération incluses dans le Rapport UK Pillar 3 s'appliquent également aux employés hors Royaume-Uni de State Street, ainsi qu'aux employés des Gestionnaires d'investissement.

## **Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité)**

La liste ci-dessous contient les plus grandes acquisitions et cessions cumulées réalisées pendant l'exercice financier clôturé le 31 mars 2023, dont le montant dépasse 1 % des acquisitions totales ou 1 % des cessions totales. Les 20 principaux achats et les 20 principales ventes au minimum doivent être communiqués, ou le total des achats et des ventes s'il est inférieur à 20.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille                                      | Coût EUR     |
|---|--------------|
| 2.625% Mercedes-Benz International Finance BV 07/04/2025    | 5 114 200    |
| 2.500% Banco Santander SA 18/03/2025                        | 4 176 760    |
| 1.250% Citigroup Inc 06/07/2026                             | 4 119 922    |
| 0.875% Deutsche Telekom International Finance BV 30/01/2024 | 4 047 813    |
| 3.500% AT&T Inc 17/12/2025                                  | 3 637 282    |
| 2.125% BNP Paribas SA 23/01/2027                            | 3 597 618    |
| 0.750% Banque Federative du Credit Mutuel SA 17/07/2025     | 3 476 216    |
| 0.750% LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE 07/04/2025       | 3 456 389    |
| 3.250% Credit Suisse Group AG 02/04/2026                    | 3 428 438    |
| 0.625% BPCE SA 28/04/2025                                   | 3 413 445    |
| 0.750% Banque Federative du Credit Mutuel SA 15/06/2023     | 3 385 250    |
| 1.500% Societe Generale SA 30/05/2025                       | 3 348 688    |
| 3.652% Australia & New Zealand Banking Group Ltd 20/01/2026 | 3 303 487    |
| 3.750% Banco Santander SA 16/01/2026                        | 3 293 619    |
| 1.250% Cooperatieve Rabobank UA 23/03/2026                  | 3 287 291    |
| 3.625% Banco Santander SA 27/09/2026                        | 3 269 430    |
| 1.090% JPMorgan Chase & Co 11/03/2027                       | 3 222 955    |
| 1.000% Credit Agricole SA 18/09/2025                        | 3 207 280    |
| 0.125% EssilorLuxottica SA 27/05/2025                       | 3 176 723    |
| 4.596% Assicurazioni Generali SpA (Perpetual)               | 3 155 892    |
| Ventes du Portefeuille                                      | Produits EUR |
| 5.000% Enel Finance International NV 14/09/2022             | 5 572 966    |
| 0.500% Banque Federative du Credit Mutuel SA 16/11/2022     | 5 201 666    |
| 2.375% Deutsche Bank AG 11/01/2023                          | 4 820 490    |
| 4.750% Cooperatieve Rabobank UA 06/06/2022                  | 4 639 227    |
| 1.000% Apple Inc 10/11/2022                                 | 4 321 174    |
| 0.750% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 11/09/2022        | 4 313 660    |
| 1.000% UniCredit SpA 18/01/2023                             | 4 308 733    |
| 1.125% CaixaBank SA 12/01/2023                              | 4 108 444    |
| 0.625% Bayer Capital Corp BV 15/12/2022                     | 4 099 789    |
| 0.250% Lloyds Bank Corporate Markets PLC 04/10/2022         | 4 068 100    |
| 0.500% FCA Bank SpA/Ireland 18/09/2023                      | 3 956 700    |
| 2.500% Iberdrola International BV 24/10/2022                | 3 931 171    |
| 1.375% Banco Santander SA 14/12/2022                        | 3 914 217    |
| 2.250% Wells Fargo & Co 02/05/2023                          | 3 843 517    |
| 0.375% Medtronic Global Holdings SCA 07/03/2023             | 3 791 158    |
| 2.625% Wells Fargo & Co 16/08/2022                          | 3 716 344    |
| 3.250% Nordea Bank Abp 05/07/2022                           | 3 692 046    |
| 2.150% Booking Holdings Inc 25/11/2022                      | 3 611 296    |
| 0.625% Cooperatieve Rabobank UA 27/02/2024                  | 3 503 952    |
| 2.000% Barclays PLC 07/02/2028                              | 3 483 675    |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille                            | Coût USD     |
|---|--------------|
| 2.500% Oracle Corp 01/04/2025                     | 818 452      |
| 3.500% Goldman Sachs Group Inc 01/04/2025         | 732 192      |
| 4.100% Bank of America Corp 24/07/2023            | 650 713      |
| 3.000% Amazon.com Inc 13/04/2025                  | 643 130      |
| 0.969% JPMorgan Chase & Co 23/06/2025             | 629 211      |
| 2.550% Walmart Inc 11/04/2023                     | 616 646      |
| 4.150% General Motors Financial Co Inc 19/06/2023 | 598 286      |
| 3.004% Bank of America Corp 20/12/2023            | 597 428      |
| 3.384% Bank of America Corp 02/04/2026            | 595 502      |
| 2.188% Wells Fargo & Co 30/04/2026                | 595 159      |
| 3.106% Citigroup Inc 08/04/2026                   | 591 724      |
| 4.875% Boeing Co 01/05/2025                       | 571 630      |
| 5.375% HCA Inc 01/02/2025                         | 565 562      |
| 4.080% JPMorgan Chase & Co 26/04/2026             | 552 583      |
| 3.620% Morgan Stanley 17/04/2025                  | 552 069      |
| 3.600% AbbVie Inc 14/05/2025                      | 549 223      |
| 1.654% Wells Fargo & Co 02/06/2024                | 548 099      |
| 4.125% Cigna Group 15/11/2025                     | 540 398      |
| 2.188% Morgan Stanley 28/04/2026                  | 536 702      |
| 0.985% Morgan Stanley 10/12/2026                  | 533 157      |
| Ventes du Portefeuille                            | Produits USD |
| 4.338% Bank of Montreal 05/10/2028                | 543 854      |
| 1.654% Wells Fargo & Co 02/06/2024                | 522 136      |
| 3.550% Bank of America Corp 05/03/2024            | 499 402      |
| 3.737% Morgan Stanley 24/04/2024                  | 498 090      |
| 4.150% General Motors Financial Co Inc 19/06/2023 | 458 285      |
| 0.732% HSBC Holdings PLC 17/08/2024               | 448 445      |
| 2.875% Microsoft Corp 06/02/2024                  | 433 169      |
| 2.600% Capital One Financial Corp 11/05/2023      | 417 481      |
| 0.969% JPMorgan Chase & Co 23/06/2025             | 413 708      |
| 2.550% Walmart Inc 11/04/2023                     | 408 567      |
| 2.800% Merck & Co Inc 18/05/2023                  | 408 317      |
| 2.850% AbbVie Inc 14/05/2023                      | 408 069      |
| 3.220% JPMorgan Chase & Co 01/03/2025             | 401 048      |
| 5.147% Banco Santander SA 18/08/2025              | 390 434      |
| 2.500% Oracle Corp 01/04/2025                     | 381 295      |
| 2.400% NIKE Inc 27/03/2025                        | 377 831      |
| 0.657% Goldman Sachs Group Inc 10/09/2024         | 377 732      |
| 3.384% Bank of America Corp 02/04/2026            | 372 556      |
| 0.523% Bank of America Corp 14/06/2024            | 372 385      |
| 1.125% Philip Morris International Inc 01/05/2023 | 365 964      |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille                        | Coût USD   |
|---|------------|
| 0.000% United States Treasury Bill 20/04/2023 | 24 382 594 |
| 0.000% United States Treasury Bill 18/05/2023 | 24 230 073 |
| 0.000% United States Treasury Bill 26/01/2023 | 22 601 833 |
| 0.000% United States Treasury Bill 23/02/2023 | 20 981 244 |
| 0.000% United States Treasury Bill 27/04/2023 | 19 457 666 |
| 0.000% United States Treasury Bill 29/12/2022 | 19 342 148 |
| 0.000% United States Treasury Bill 04/05/2023 | 19 175 711 |
| 0.000% United States Treasury Bill 13/04/2023 | 18 924 634 |
| 0.000% United States Treasury Bill 25/05/2023 | 18 891 893 |
| 0.000% United States Treasury Bill 23/03/2023 | 18 640 496 |
| 0.000% United States Treasury Bill 11/05/2023 | 18 191 626 |
| 0.000% United States Treasury Bill 04/04/2023 | 17 028 045 |
| 0.000% United States Treasury Bill 11/04/2023 | 17 010 742 |
| 0.000% United States Treasury Bill 25/04/2023 | 16 946 369 |
| 0.000% United States Treasury Bill 06/04/2023 | 16 916 902 |
| 0.000% United States Treasury Bill 12/01/2023 | 16 680 932 |
| 0.000% United States Treasury Bill 19/01/2023 | 16 617 596 |
| 0.000% United States Treasury Bill 18/04/2023 | 16 497 350 |
| 0.000% United States Treasury Bill 16/02/2023 | 16 364 846 |
| 0.000% United States Treasury Bill 03/11/2022 | 16 180 531 |
| 0.000% United States Treasury Bill 05/01/2023 | 15 950 284 |
| 0.000% United States Treasury Bill 16/03/2023 | 15 633 537 |
| 0.000% United States Treasury Bill 01/12/2022 | 15 345 453 |
| 0.000% United States Treasury Bill 02/02/2023 | 15 020 798 |
| 0.000% United States Treasury Bill 08/09/2022 | 14 690 416 |
| 0.000% United States Treasury Bill 09/02/2023 | 14 689 025 |
| 0.000% United States Treasury Bill 01/11/2022 | 14 573 644 |
| 0.000% United States Treasury Bill 21/03/2023 | 14 332 738 |
| 0.000% United States Treasury Bill 28/03/2023 | 14 330 173 |
| 0.000% United States Treasury Bill 06/10/2022 | 14 296 260 |
| 0.000% United States Treasury Bill 15/12/2022 | 14 284 486 |
| 0.000% United States Treasury Bill 08/12/2022 | 14 280 528 |
| 0.000% United States Treasury Bill 22/12/2022 | 14 248 774 |
| 0.000% United States Treasury Bill 30/03/2023 | 14 205 892 |
| 0.000% United States Treasury Bill 09/03/2023 | 14 157 320 |
| 0.000% United States Treasury Bill 14/07/2022 | 13 761 261 |
| 0.000% United States Treasury Bill 02/03/2023 | 13 446 901 |
| 0.000% United States Treasury Bill 10/01/2023 | 13 146 399 |
| 0.000% United States Treasury Bill 17/01/2023 | 13 064 671 |
| 0.000% United States Treasury Bill 14/03/2023 | 13 058 465 |
| 0.000% United States Treasury Bill 27/10/2022 | 12 934 182 |
| 0.000% United States Treasury Bill 03/01/2023 | 12 927 741 |
| 0.000% United States Treasury Bill 20/12/2022 | 12 707 757 |
| 0.000% United States Treasury Bill 27/12/2022 | 12 566 559 |



## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF (non audité) (suite)

| Ventes du Portefeuille                        | Produits USD |
|---|--------------|
| 0.000% United States Treasury Bill 26/01/2023 | 22 727 095   |
| 0.000% United States Treasury Bill 23/02/2023 | 21 091 762   |
| 0.000% United States Treasury Bill 29/12/2022 | 19 422 658   |
| 0.000% United States Treasury Bill 23/03/2023 | 18 748 998   |
| 0.000% United States Treasury Bill 12/01/2023 | 16 771 063   |
| 0.000% United States Treasury Bill 19/01/2023 | 16 709 419   |
| 0.000% United States Treasury Bill 16/02/2023 | 16 450 707   |
| 0.000% United States Treasury Bill 03/11/2022 | 16 236 055   |
| 0.000% United States Treasury Bill 05/01/2023 | 16 034 711   |
| 0.000% United States Treasury Bill 16/03/2023 | 15 711 283   |
| 0.000% United States Treasury Bill 01/12/2022 | 15 389 703   |
| 0.000% United States Treasury Bill 02/02/2023 | 15 104 124   |
| 0.000% United States Treasury Bill 09/02/2023 | 14 775 748   |
| 0.000% United States Treasury Bill 08/09/2022 | 14 721 937   |
| 0.000% United States Treasury Bill 21/03/2023 | 14 386 927   |
| 0.000% United States Treasury Bill 28/03/2023 | 14 384 408   |
| 0.000% United States Treasury Bill 15/12/2022 | 14 341 890   |
| 0.000% United States Treasury Bill 08/12/2022 | 14 339 205   |
| 0.000% United States Treasury Bill 06/10/2022 | 14 337 784   |
| 0.000% United States Treasury Bill 22/12/2022 | 14 309 719   |
| 0.000% United States Treasury Bill 30/03/2023 | 14 287 607   |
| 0.000% United States Treasury Bill 09/03/2023 | 14 238 129   |
| 0.000% United States Treasury Bill 14/07/2022 | 13 773 844   |
| 0.000% United States Treasury Bill 02/03/2023 | 13 523 245   |
| 0.000% United States Treasury Bill 19/05/2022 | 13 498 734   |
| 0.000% United States Treasury Bill 21/04/2022 | 13 299 130   |
| 0.000% United States Treasury Bill 10/01/2023 | 13 184 769   |
| 0.000% United States Treasury Bill 14/03/2023 | 13 110 760   |
| 0.000% United States Treasury Bill 17/01/2023 | 13 104 777   |
| 0.000% United States Treasury Bill 27/10/2022 | 12 966 983   |
| 0.000% United States Treasury Bill 20/12/2022 | 12 744 755   |
| 0.000% United States Treasury Bill 27/12/2022 | 12 604 258   |
| 0.000% United States Treasury Bill 07/03/2023 | 12 413 019   |
| 0.000% United States Treasury Bill 16/06/2022 | 12 396 591   |
| 0.000% United States Treasury Bill 11/08/2022 | 12 253 418   |
| 0.000% United States Treasury Bill 17/11/2022 | 12 235 167   |
| 0.000% United States Treasury Bill 24/01/2023 | 12 167 978   |
| 0.000% United States Treasury Bill 10/11/2022 | 12 092 591   |
| 0.000% United States Treasury Bill 13/12/2022 | 11 736 138   |
| 0.000% United States Treasury Bill 20/10/2022 | 11 680 345   |
| 0.000% United States Treasury Bill 21/07/2022 | 11 392 323   |
| 0.000% United States Treasury Bill 07/07/2022 | 11 347 369   |
| 0.000% United States Treasury Bill 25/11/2022 | 11 325 776   |
| 0.000% United States Treasury Bill 06/12/2022 | 11 204 156   |
| 0.000% United States Treasury Bill 13/10/2022 | 10 787 031   |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille                                     | Coût EUR   |
|--|------------|
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/03/2025      | 31 184 148 |
| 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2025      | 25 502 221 |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/02/2025      | 19 397 663 |
| 6.000% French Republic Government Bond OAT 25/10/2025      | 18 987 045 |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/02/2026      | 17 982 278 |
| 5.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2025        | 16 081 065 |
| 1.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2025 | 15 764 494 |
| 1.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2025      | 15 626 942 |
| 0.000% Bundesobligation 11/04/2025                         | 14 904 919 |
| 4.650% Spain Government Bond 30/07/2025                    | 14 318 091 |
| 2.150% Spain Government Bond 31/10/2025                    | 14 248 782 |
| 0.000% Bundesobligation 10/10/2025                         | 14 170 355 |
| 0.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2026 | 13 649 349 |
| 0.400% Bundesschatzanweisungen 13/09/2024                  | 13 612 340 |
| 0.000% Bundesschatzanweisungen 15/03/2024                  | 13 310 992 |
| 1.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/05/2025        | 13 296 088 |
| 1.600% Spain Government Bond 30/04/2025                    | 13 275 821 |
| 2.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2025        | 11 868 771 |
| 0.000% Spain Government Bond 31/05/2025                    | 11 866 422 |
| 4.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2026        | 11 489 016 |
| 0.250% Netherlands Government Bond 15/07/2025              | 11 449 888 |
| 0.200% Bundesschatzanweisungen 14/06/2024                  | 11 340 921 |
| 1.850% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/07/2025        | 9 918 810  |
| 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/12/2024        | 9 829 079  |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/03/2024      | 9 210 617  |
| 1.200% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/08/2025        | 8 803 483  |
| 2.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/11/2025        | 8 573 685  |
| 1.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 30/05/2024        | 8 400 386  |
| 2.875% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 15/10/2025        | 8 011 117  |
| 3.800% Spain Government Bond 30/04/2024                    | 7 776 111  |
| 0.000% Bundesobligation 10/10/2025                         | 7 604 017  |
| 3.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/01/2026        | 7 342 314  |
| 2.200% Bundesschatzanweisungen 12/12/2024                  | 7 275 498  |
| 5.400% Ireland Government Bond 13/03/2025                  | 7 239 392  |
| 0.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/02/2026        | 6 755 018  |
| 1.200% Republic of Austria Government Bond 20/10/2025      | 6 679 517  |
| 2.500% Bundesschatzanweisungen 13/03/2025                  | 6 640 789  |
| 0.000% Republic of Austria Government Bond 20/04/2025      | 6 365 851  |

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF (non audité) (suite)

| Ventes du Portefeuille                                     | Produits EUR |
|--|--------------|
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/03/2024      | 29 726 760   |
| 4.250% French Republic Government Bond OAT 25/10/2023      | 24 403 617   |
| 1.750% French Republic Government Bond OAT 25/05/2023      | 22 767 826   |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/03/2023      | 19 553 259   |
| 0.000% Bundesschatzanweisungen 15/03/2024                  | 14 973 583   |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/02/2024      | 14 283 187   |
| 2.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2023 | 13 677 438   |
| 4.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2023        | 13 620 380   |
| 1.750% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2024 | 13 072 877   |
| 4.800% Spain Government Bond 31/01/2024                    | 11 630 122   |
| 0.350% Spain Government Bond 30/07/2023                    | 10 873 163   |
| 0.000% Spain Government Bond 30/04/2023                    | 10 549 961   |
| 1.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/05/2023 | 10 452 113   |
| 0.000% Bundesschatzanweisungen 15/12/2023                  | 10 325 867   |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/02/2025      | 10 225 478   |
| 0.000% Netherlands Government Bond 15/01/2024              | 10 167 753   |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/03/2025      | 9 826 699    |
| 0.600% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/06/2023        | 9 735 658    |
| 0.000% Bundesobligation 13/10/2023                         | 9 667 859    |
| 0.000% Bundesschatzanweisungen 16/06/2023                  | 9 622 650    |
| 0.300% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/08/2023        | 9 386 669    |
| 1.750% Netherlands Government Bond 15/07/2023              | 8 950 829    |
| 4.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/05/2023        | 8 632 337    |
| 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 30/01/2024        | 8 559 402    |
| 0.000% Bundesobligation 14/04/2023                         | 8 537 191    |
| 0.000% Bundesschatzanweisungen 15/09/2023                  | 8 329 951    |
| 3.800% Spain Government Bond 30/04/2024                    | 8 115 923    |
| 1.750% French Republic Government Bond OAT 25/11/2024      | 7 920 701    |
| 2.250% French Republic Government Bond OAT 25/05/2024      | 7 496 893    |
| 6.250% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/01/2024 | 7 489 817    |
| 0.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2023        | 7 455 388    |
| 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/01/2024        | 7 150 642    |
| 0.000% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/12/2024        | 6 842 069    |
| 4.950% Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 25/10/2023        | 6 814 448    |
| 1.450% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/05/2025        | 6 796 860    |
| 0.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/03/2023        | 6 698 370    |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille                             | Coût USD  |
|--|-----------|
| 2.625% United States Treasury Note/Bond 15/04/2025 | 4 571 622 |
| 2.500% United States Treasury Note/Bond 30/04/2024 | 4 290 426 |
| 2.250% United States Treasury Note/Bond 31/03/2024 | 4 271 356 |
| 0.375% United States Treasury Note/Bond 15/08/2024 | 4 069 298 |
| 0.375% United States Treasury Note/Bond 30/04/2025 | 3 925 986 |
| 1.500% United States Treasury Note/Bond 15/02/2025 | 3 875 904 |
| 1.750% United States Treasury Note/Bond 15/03/2025 | 3 861 322 |
| 2.875% United States Treasury Note/Bond 15/06/2025 | 3 828 831 |
| 2.125% United States Treasury Note/Bond 15/05/2025 | 3 775 849 |
| 0.500% United States Treasury Note/Bond 31/03/2025 | 3 769 729 |
| 2.500% United States Treasury Note/Bond 31/05/2024 | 3 730 069 |
| 1.125% United States Treasury Note/Bond 15/01/2025 | 3 671 296 |
| 2.375% United States Treasury Note/Bond 15/08/2024 | 3 610 251 |
| 1.000% United States Treasury Note/Bond 15/12/2024 | 3 498 586 |
| 2.750% United States Treasury Note/Bond 15/05/2025 | 3 489 421 |
| 2.250% United States Treasury Note/Bond 15/11/2024 | 3 440 045 |
| 0.375% United States Treasury Note/Bond 15/09/2024 | 3 417 999 |
| 3.000% United States Treasury Note/Bond 30/06/2024 | 3 403 539 |
| 0.250% United States Treasury Note/Bond 15/03/2024 | 3 251 638 |
| 2.000% United States Treasury Note/Bond 15/02/2025 | 3 217 532 |
| 2.000% United States Treasury Note/Bond 15/08/2025 | 3 130 737 |
| 0.375% United States Treasury Note/Bond 31/10/2023 | 3 101 419 |
| 0.125% United States Treasury Note/Bond 15/02/2024 | 3 095 370 |
| 0.750% United States Treasury Note/Bond 15/11/2024 | 3 036 529 |
| 0.625% United States Treasury Note/Bond 15/10/2024 | 3 034 744 |
| 2.500% United States Treasury Note/Bond 15/05/2024 | 3 022 116 |
| 3.000% United States Treasury Note/Bond 15/07/2025 | 2 983 886 |
| 0.125% United States Treasury Note/Bond 15/01/2024 | 2 842 987 |
| 0.250% United States Treasury Note/Bond 30/06/2025 | 2 785 572 |
| 1.500% United States Treasury Note/Bond 29/02/2024 | 2 719 540 |
| 4.000% United States Treasury Note/Bond 15/06/2045 | 2 620 198 |

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF (non audité) (suite)

| Ventes du Portefeuille                             | Produits USD |
|--|--------------|
| 0.250% United States Treasury Note/Bond 15/03/2024 | 5 561 242    |
| 0.125% United States Treasury Note/Bond 15/02/2024 | 5 268 592    |
| 1.500% United States Treasury Note/Bond 29/02/2024 | 5 144 059    |
| 0.375% United States Treasury Note/Bond 31/10/2023 | 5 113 240    |
| 0.375% United States Treasury Note/Bond 15/08/2024 | 4 672 844    |
| 0.500% United States Treasury Note/Bond 30/11/2023 | 4 665 242    |
| 0.125% United States Treasury Note/Bond 31/07/2023 | 4 646 262    |
| 1.500% United States Treasury Note/Bond 15/02/2025 | 4 569 134    |
| 2.375% United States Treasury Note/Bond 15/08/2024 | 4 567 628    |
| 2.250% United States Treasury Note/Bond 15/11/2024 | 4 508 467    |
| 0.125% United States Treasury Note/Bond 31/08/2023 | 4 421 719    |
| 0.125% United States Treasury Note/Bond 15/01/2024 | 4 408 244    |
| 1.000% United States Treasury Note/Bond 15/12/2024 | 4 344 766    |
| 0.125% United States Treasury Note/Bond 15/12/2023 | 4 286 697    |
| 0.375% United States Treasury Note/Bond 15/09/2024 | 4 262 994    |
| 2.750% United States Treasury Note/Bond 15/02/2024 | 4 257 730    |
| 2.250% United States Treasury Note/Bond 31/03/2024 | 4 227 485    |
| 1.125% United States Treasury Note/Bond 15/01/2025 | 4 195 698    |
| 2.750% United States Treasury Note/Bond 15/11/2023 | 4 134 218    |
| 2.000% United States Treasury Note/Bond 15/02/2025 | 4 130 366    |
| 0.750% United States Treasury Note/Bond 31/12/2023 | 4 127 330    |
| 0.250% United States Treasury Note/Bond 30/09/2023 | 4 107 766    |
| 0.375% United States Treasury Note/Bond 15/04/2024 | 4 082 896    |
| 0.875% United States Treasury Note/Bond 31/01/2024 | 4 078 650    |
| 2.500% United States Treasury Note/Bond 15/08/2023 | 4 055 872    |
| 0.125% United States Treasury Note/Bond 30/06/2023 | 3 967 616    |
| 0.625% United States Treasury Note/Bond 15/10/2024 | 3 962 153    |
| 0.250% United States Treasury Note/Bond 15/11/2023 | 3 874 021    |
| 0.750% United States Treasury Note/Bond 15/11/2024 | 3 853 487    |
| 2.125% United States Treasury Note/Bond 31/03/2024 | 3 667 156    |
| 2.500% United States Treasury Note/Bond 15/05/2024 | 3 446 093    |
| 0.125% United States Treasury Note/Bond 15/10/2023 | 3 381 917    |
| 0.125% United States Treasury Note/Bond 15/07/2023 | 3 360 884    |
| 2.625% United States Treasury Note/Bond 15/04/2025 | 3 276 979    |
| 0.125% United States Treasury Note/Bond 31/05/2023 | 3 230 052    |
| 0.375% United States Treasury Note/Bond 15/07/2024 | 3 204 935    |
| 2.500% United States Treasury Note/Bond 30/04/2024 | 3 140 839    |
| 0.250% United States Treasury Note/Bond 15/05/2024 | 3 130 090    |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille                               | Coût USD     |
|--|--------------|
| 6.296% Morgan Stanley 18/10/2028                     | 512 939      |
| 3.620% Morgan Stanley 17/04/2025                     | 451 952      |
| 5.250% Amgen Inc 02/03/2033                          | 396 618      |
| 4.376% Bank of America Corp 27/04/2028               | 388 686      |
| 2.355% Verizon Communications Inc 15/03/2032         | 373 831      |
| 4.571% Bank of America Corp 27/04/2033               | 368 605      |
| 2.196% Boeing Co 04/02/2026                          | 367 524      |
| 0.969% JPMorgan Chase & Co 23/06/2025                | 366 865      |
| 3.900% Bristol-Myers Squibb Co 20/02/2028            | 364 078      |
| 2.300% AT&T Inc 01/06/2027                           | 357 135      |
| 3.272% Goldman Sachs Group Inc 29/09/2025            | 356 828      |
| 1.734% Bank of America Corp 22/07/2027               | 354 218      |
| 2.650% Oracle Corp 15/07/2026                        | 352 607      |
| 3.700% Walt Disney Co 15/09/2024                     | 352 357      |
| 0.953% Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 19/07/2025 | 348 604      |
| 1.953% JPMorgan Chase & Co 04/02/2032                | 346 240      |
| 3.150% Amazon.com Inc 22/08/2027                     | 343 174      |
| 2.871% HSBC Holdings PLC 22/11/2032                  | 342 255      |
| 5.294% Banco Santander SA 18/08/2027                 | 341 088      |
| 3.841% Bank of America Corp 25/04/2025               | 340 918      |
| Ventes du Portefeuille                               | Produits USD |
| 5.671% PNC Financial Services Group Inc 28/10/2025   | 300 965      |
| 3.803% HSBC Holdings PLC 11/03/2025                  | 287 953      |
| 4.658% Citigroup Inc 24/05/2028                      | 286 178      |
| 1.654% Wells Fargo & Co 02/06/2024                   | 274 476      |
| 4.300% Citigroup Inc 20/11/2026                      | 268 556      |
| 0.523% Bank of America Corp 14/06/2024               | 260 968      |
| 3.093% Bank of America Corp 01/10/2025               | 258 053      |
| 3.950% US Bancorp 17/11/2025                         | 249 951      |
| 4.023% JPMorgan Chase & Co 05/12/2024                | 246 356      |
| 3.220% JPMorgan Chase & Co 01/03/2025                | 244 749      |
| 4.269% NatWest Group PLC 22/03/2025                  | 244 720      |
| 1.512% Morgan Stanley 20/07/2027                     | 241 153      |
| 3.620% Morgan Stanley 17/04/2025                     | 235 138      |
| 3.702% JPMorgan Chase & Co 06/05/2030                | 232 740      |
| 0.791% Morgan Stanley 22/01/2025                     | 228 746      |
| 0.810% Bank of America Corp 24/10/2024               | 223 391      |
| 3.375% Simon Property Group LP 15/06/2027            | 219 372      |
| 4.210% Morgan Stanley 20/04/2028                     | 213 420      |
| 5.000% HCA Inc 15/03/2024                            | 211 940      |
| 1.343% Capital One Financial Corp 06/12/2024         | 210 888      |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille                                      | Coût USD     |
|---|--------------|
| 3.750% Republic of Poland Government Bond 25/05/2027        | 31 645 370   |
| 0.000% Brazil Letras do Tesouro Nacional 01/01/2024         | 28 216 778   |
| 10.000% Mexican Bonos 05/12/2024                            | 23 640 492   |
| 0.000% Brazil Letras do Tesouro Nacional 01/07/2025         | 21 709 574   |
| 8.750% Republic of South Africa Government Bond 31/01/2044  | 17 839 255   |
| 0.000% Brazil Letras do Tesouro Nacional 01/01/2026         | 17 100 900   |
| 2.500% Republic of Poland Government Bond 25/07/2027        | 16 488 428   |
| 4.193% Malaysia Government Investment Issue 07/10/2032      | 14 706 183   |
| 10.000% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/2033 | 14 578 794   |
| 8.000% Republic of South Africa Government Bond 31/01/2030  | 13 979 094   |
| 7.000% Indonesia Treasury Bond 15/02/2033                   | 13 919 083   |
| 2.000% Thailand Government Bond 17/12/2031                  | 13 889 383   |
| 3.899% Malaysia Government Bond 16/11/2027                  | 13 706 762   |
| 1.875% Korea Treasury Bond 10/03/2051                       | 13 474 413   |
| 2.250% Republic of Poland Government Bond 25/10/2024        | 12 613 161   |
| 1.585% Thailand Government Bond 17/12/2035                  | 11 475 409   |
| 8.500% Mexican Bonos 18/11/2038                             | 11 475 365   |
| 5.000% Mexican Bonos 06/03/2025                             | 11 393 921   |
| 10.000% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/2027 | 10 890 688   |
| 8.250% Republic of South Africa Government Bond 31/03/2032  | 10 575 009   |
| Ventes du Portefeuille                                      | Produits USD |
| 2.500% Republic of Poland Government Bond 25/07/2027        | 30 104 324   |
| 10.000% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/2025 | 27 419 440   |
| 10.000% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/2023 | 27 366 803   |
| 8.000% Mexican Bonos 05/09/2024                             | 21 714 501   |
| 0.000% Brazil Letras do Tesouro Nacional 01/01/2024         | 19 946 245   |
| 5.750% Mexican Bonos 05/03/2026                             | 19 935 345   |
| 8.750% Republic of South Africa Government Bond 31/01/2044  | 19 379 789   |
| 8.000% Mexican Bonos 07/12/2023                             | 18 222 383   |
| 8.875% Republic of South Africa Government Bond 28/02/2035  | 17 572 922   |
| 1.000% Korea Treasury Bond 10/06/2023                       | 16 389 038   |
| 2.750% Republic of Poland Government Bond 25/10/2029        | 16 300 013   |
| 0.750% Republic of Poland Government Bond 25/04/2025        | 15 321 482   |
| 10.000% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/2027 | 14 835 215   |
| 8.000% Republic of South Africa Government Bond 31/01/2030  | 14 331 467   |
| 0.875% Korea Treasury Bond 10/12/2023                       | 13 703 353   |
| 8.375% Indonesia Treasury Bond 15/03/2024                   | 13 544 267   |
| 2.000% Thailand Government Bond 17/12/2031                  | 12 875 610   |
| 8.500% Mexican Bonos 18/11/2038                             | 11 981 994   |
| 5.625% Indonesia Treasury Bond 15/05/2023                   | 11 628 331   |
| 7.750% Mexican Bonos 23/11/2034                             | 11 616 316   |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille                                     | Coût EUR     |
|--|--------------|
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/05/2032      | 2 985 767    |
| 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/02/2028      | 2 458 926    |
| 1.300% Bundesobligation 15/10/2027                         | 2 238 354    |
| 2.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2032      | 2 215 086    |
| 1.100% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/04/2027        | 2 018 361    |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2031      | 1 630 955    |
| 1.750% French Republic Government Bond OAT 25/11/2024      | 1 628 035    |
| 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2032 | 1 621 630    |
| 0.000% Bundesobligation 16/04/2027                         | 1 499 862    |
| 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/11/2027 | 1 492 308    |
| 2.800% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/06/2029        | 1 346 816    |
| 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2026      | 1 315 010    |
| 2.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2032        | 1 262 918    |
| 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/05/2028      | 1 229 417    |
| 0.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2026 | 1 229 190    |
| 0.700% Spain Government Bond 30/04/2032                    | 1 207 994    |
| 0.800% Spain Government Bond 30/07/2029                    | 1 198 454    |
| 0.000% Spain Government Bond 31/01/2027                    | 1 195 896    |
| 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/11/2028      | 1 194 623    |
| 1.700% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2032 | 1 117 333    |
| Ventes du Portefeuille                                     | Produits EUR |
| 4.250% French Republic Government Bond OAT 25/10/2023      | 2 248 468    |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/03/2024      | 2 145 748    |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/05/2032      | 1 725 323    |
| 1.750% French Republic Government Bond OAT 25/11/2024      | 1 625 403    |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2031      | 1 622 422    |
| 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/11/2027 | 1 573 560    |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/03/2023      | 1 445 861    |
| 1.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/07/2024        | 1 286 764    |
| 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2026      | 1 268 389    |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/03/2025      | 1 237 609    |
| 1.300% Bundesobligation 15/10/2027                         | 1 229 143    |
| 1.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/05/2023 | 1 146 764    |
| 4.750% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/08/2023        | 1 139 004    |
| 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2032 | 1 108 850    |
| 2.750% French Republic Government Bond OAT 25/10/2027      | 1 095 800    |
| 1.750% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2024 | 1 091 411    |
| 0.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2026 | 1 083 663    |
| 4.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2024        | 1 051 978    |
| 0.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 15/09/2027        | 1 023 718    |
| 1.100% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/04/2027        | 1 017 729    |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.



## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille                                     | Coût EUR   |
|--|------------|
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/02/2027      | 11 513 149 |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/05/2032      | 11 305 474 |
| 1.100% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/04/2027        | 11 188 395 |
| 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/02/2028      | 10 974 141 |
| 0.000% Bundesschatzanweisungen 15/03/2024                  | 10 187 459 |
| 0.000% Bundesobligation 16/04/2027                         | 10 019 493 |
| 2.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2032      | 9 123 811  |
| 0.000% Spain Government Bond 31/01/2027                    | 8 544 883  |
| 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/05/2028      | 7 909 248  |
| 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/02/2032 | 7 715 262  |
| 2.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2044 | 7 581 532  |
| 2.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/12/2032        | 7 009 071  |
| 1.300% Bundesobligation 15/10/2027                         | 6 460 582  |
| 0.700% Spain Government Bond 30/04/2032                    | 6 307 771  |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2031      | 6 142 196  |
| 0.350% Kingdom of Belgium Government Bond 22/06/2032       | 6 041 423  |
| 1.700% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2032 | 5 940 491  |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/02/2025      | 5 863 565  |
| 0.000% Spain Government Bond 31/01/2028                    | 5 816 715  |
| 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2031 | 5 693 314  |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/02/2024      | 5 685 747  |

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF (non audité) (suite)

| Ventes du Portefeuille                                     | Produits EUR |
|--|--------------|
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/02/2027      | 10 168 144   |
| 1.100% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/04/2027        | 8 618 192    |
| 0.000% Spain Government Bond 31/01/2027                    | 8 407 501    |
| 4.250% French Republic Government Bond OAT 25/10/2023      | 8 390 200    |
| 0.000% Bundesobligation 16/04/2027                         | 7 139 432    |
| 2.500% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/2044 | 6 947 743    |
| 0.000% Spain Government Bond 30/04/2023                    | 6 784 273    |
| 0.000% Bundesschatzanweisungen 15/03/2024                  | 6 577 547    |
| 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/02/2028      | 6 477 117    |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/02/2024      | 6 039 992    |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/05/2032      | 6 011 567    |
| 0.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2031 | 5 958 298    |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2031      | 5 780 089    |
| 1.750% French Republic Government Bond OAT 25/11/2024      | 5 585 434    |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/03/2023      | 5 575 601    |
| 0.000% Bundesobligation 09/10/2026                         | 5 311 437    |
| 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/05/2028      | 5 211 712    |
| 0.500% French Republic Government Bond OAT 25/05/2040      | 5 089 131    |
| 0.950% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/06/2032        | 5 046 611    |
| 1.800% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2041        | 4 759 668    |
| 2.000% Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/2023 | 4 710 544    |
| 0.500% Spain Government Bond 31/10/2031                    | 4 634 503    |
| 0.000% Bundesschatzanweisungen 15/09/2023                  | 4 496 767    |
| 0.700% Spain Government Bond 30/04/2032                    | 4 492 418    |
| 0.350% Spain Government Bond 30/07/2023                    | 4 488 835    |
| 0.750% French Republic Government Bond OAT 25/05/2053      | 4 361 299    |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille   | Coût EUR     |
|--|--------------|
| 2.250% Cellnex Finance Co SA 12/04/2026                            | 3 680 730    |
| 4.000% Telecom Italia SpA/Milano 11/04/2024                        | 2 993 881    |
| 8.000% Altice France Holding SA 15/05/2027                         | 2 906 404    |
| 1.875% iliad SA 25/04/2025   | 2 813 942    |
| 4.375% eG Global Finance PLC 07/02/2025                            | 2 801 366    |
| 5.750% Summer BC Holdco B SARL 31/10/2026                          | 2 710 957    |
| 3.000% Netflix Inc 15/06/2025                                      | 2 644 014    |
| 4.000% Lorca Telecom Bondco SA 18/09/2027                          | 2 609 141    |
| 3.200% Grifols SA 01/05/2025                                       | 2 593 326    |
| 2.875% Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 30/04/2028 | 2 583 620    |
| 3.625% Netflix Inc 15/05/2027                                      | 2 551 115    |
| 1.125% Banco de Sabadell SA 27/03/2025                             | 2 539 640    |
| 1.750% Banco de Sabadell SA 10/05/2024                             | 2 528 591    |
| 1.625% Nexi SpA 30/04/2026   | 2 480 577    |
| 3.500% eircom Finance DAC 15/05/2026                               | 2 476 981    |
| 5.125% Kaixo Bondco Telecom SA 30/09/2029                          | 2 462 319    |
| 1.625% Banco BPM SpA 18/02/2025                                    | 2 378 668    |
| 3.875% Grifols Escrow Issuer SA 15/10/2028                         | 2 377 011    |
| 5.000% Cidron Aida Finco Sarl 01/04/2028                           | 2 373 545    |
| 3.750% INEOS Quattro Finance 1 Plc 15/07/2026                      | 2 367 256    |
| Ventes du Portefeuille   | Produits EUR |
| 2.875% thyssenkrupp AG 22/02/2024                                  | 4 924 765    |
| 2.000% Autostrade per l'Italia SpA 04/12/2028                      | 3 938 509    |
| 3.021% Ford Motor Credit Co LLC 06/03/2024                         | 3 537 785    |
| 4.000% Telecom Italia SpA/Milano 11/04/2024                        | 3 494 651    |
| 3.625% Netflix Inc 15/05/2027                                      | 3 136 866    |
| 8.000% Altice France Holding SA 15/05/2027                         | 2 884 473    |
| 3.125% SoftBank Group Corp 19/09/2025                              | 2 862 967    |
| 4.000% Lorca Telecom Bondco SA 18/09/2027                          | 2 824 774    |
| 1.625% Nexi SpA 30/04/2026   | 2 811 028    |
| 0.875% Ball Corp 15/03/2024  | 2 803 398    |
| 2.375% Cellnex Telecom SA 16/01/2024                               | 2 798 085    |
| 5.250% Verisure Midholding AB 15/02/2029                           | 2 702 136    |
| 2.875% Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 30/04/2028 | 2 681 581    |
| 1.625% Banco BPM SpA 18/02/2025                                    | 2 650 804    |
| 3.750% INEOS Quattro Finance 1 Plc 15/07/2026                      | 2 618 789    |
| 1.125% Banco de Sabadell SA 27/03/2025                             | 2 608 808    |
| 3.875% Grifols Escrow Issuer SA 15/10/2028                         | 2 605 246    |
| 4.875% United Group BV 01/07/2024                                  | 2 579 693    |
| 5.750% Summer BC Holdco B SARL 31/10/2026                          | 2 545 400    |
| 5.125% Kaixo Bondco Telecom SA 30/09/2029                          | 2 542 549    |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille                             | Coût USD     |
|--|--------------|
| 0.000% United States Treasury Bill 11/05/2023      | 21 632 650   |
| 0.000% United States Treasury Bill 13/04/2023      | 19 297 884   |
| 0.000% United States Treasury Bill 14/07/2022      | 15 275 067   |
| 0.000% United States Treasury Bill 11/08/2022      | 15 072 279   |
| 0.000% United States Treasury Bill 12/01/2023      | 12 444 717   |
| 0.000% United States Treasury Bill 08/12/2022      | 11 580 431   |
| 0.000% United States Treasury Bill 09/03/2023      | 11 392 417   |
| 0.000% United States Treasury Bill 13/10/2022      | 11 006 340   |
| 0.000% United States Treasury Bill 08/09/2022      | 10 668 478   |
| 0.000% United States Treasury Bill 09/02/2023      | 10 419 964   |
| 0.200% Japan Government Ten Year Bond 20/06/2032   | 9 787 494    |
| 0.200% Japan Government Ten Year Bond 20/03/2032   | 8 242 969    |
| 0.200% Japan Government Ten Year Bond 20/09/2032   | 6 949 622    |
| 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/12/2031   | 6 850 041    |
| 0.000% United States Treasury Bill 08/06/2023      | 6 670 328    |
| 0.100% Japan Government Five Year Bond 20/09/2027  | 6 317 227    |
| 0.005% Japan Government Five Year Bond 20/06/2027  | 5 918 267    |
| 2.875% United States Treasury Note/Bond 15/05/2032 | 5 865 947    |
| 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/12/2029   | 5 197 276    |
| 0.005% Japan Government Five Year Bond 20/03/2027  | 5 001 303    |
| Ventes du Portefeuille                             | Produits USD |
| 0.000% United States Treasury Bill 11/08/2022      | 12 187 971   |
| 0.000% United States Treasury Bill 11/05/2023      | 10 897 432   |
| 0.100% Japan Government Five Year Bond 20/06/2023  | 5 446 460    |
| 0.000% United States Treasury Bill 13/04/2023      | 5 305 699    |
| 0.000% United States Treasury Bill 02/06/2022      | 4 497 418    |
| 0.000% United States Treasury Bill 08/12/2022      | 4 230 006    |
| 1.875% United States Treasury Note/Bond 15/02/2032 | 3 896 924    |
| 0.200% Japan Government Ten Year Bond 20/06/2032   | 3 188 243    |
| 0.000% United States Treasury Bill 14/07/2022      | 3 098 052    |
| 2.880% China Government Bond 05/11/2023            | 3 000 665    |
| 3.000% China Development Bank 07/08/2023           | 2 999 668    |
| 0.100% Japan Government Five Year Bond 20/09/2023  | 2 995 289    |
| 0.100% Japan Government Five Year Bond 20/12/2023  | 2 952 274    |
| 2.500% United States Treasury Note/Bond 31/05/2024 | 2 929 570    |
| 0.000% United States Treasury Bill 13/10/2022      | 2 891 895    |
| 0.000% United States Treasury Bill 12/01/2023      | 2 783 700    |
| 0.100% Japan Government Ten Year Bond 20/12/2031   | 2 679 728    |
| 2.760% China Government Bond 15/05/2032            | 2 501 792    |
| 3.500% United States Treasury Note/Bond 15/02/2033 | 2 425 469    |
| 3.125% United States Treasury Note/Bond 31/08/2027 | 2 419 789    |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille   | Coût USD   |
|--|------------|
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2032 | 15 183 513 |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/04/2027 | 14 817 687 |
| 1.625% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/10/2027 | 12 990 936 |
| 0.625% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2032 | 12 456 913 |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2031 | 7 604 625  |
| 0.250% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2025 | 7 506 381  |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/10/2026 | 6 779 618  |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2031 | 6 741 009  |
| 2.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2041 | 6 654 600  |
| 2.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2025 | 6 519 004  |
| 0.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2027 | 6 283 469  |
| 2.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2027 | 6 173 007  |
| 0.500% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2028 | 6 134 770  |
| 0.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2027 | 6 019 397  |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/04/2025 | 5 626 155  |
| 2.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2040 | 5 540 615  |
| 0.625% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2026 | 5 480 936  |
| 0.750% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2042 | 4 848 532  |
| 0.250% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2050 | 4 756 996  |
| 2.000% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2026 | 4 734 798  |
| 1.750% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2028 | 4 693 381  |
| 0.250% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2029 | 4 616 440  |
| 0.625% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2024 | 4 448 184  |
| 0.750% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2028 | 4 342 681  |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/10/2024 | 4 322 854  |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/04/2026 | 4 251 367  |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2026 | 4 217 903  |
| 1.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2044 | 4 032 448  |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/10/2025 | 3 825 023  |
| 0.500% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/04/2024 | 3 693 751  |
| 0.625% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2043 | 3 656 750  |
| 1.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2033 | 3 649 059  |
| 0.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2025 | 3 630 478  |
| 3.625% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/04/2028 | 3 567 713  |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2024 | 3 494 896  |
| 1.000% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2049 | 3 038 274  |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2052 | 2 775 084  |
| 2.500% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2029 | 2 498 236  |

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF (non audité) (suite)

| Ventes du Portefeuille   | Produits USD |
|--|--------------|
| 0.625% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2024 | 16 177 423   |
| 0.625% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/04/2023 | 14 688 864   |
| 0.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2023 | 14 472 973   |
| 0.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2027 | 8 606 309    |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2031 | 8 507 285    |
| 0.250% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2025 | 8 428 452    |
| 0.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2027 | 7 864 508    |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2032 | 7 621 997    |
| 2.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2025 | 7 582 082    |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/10/2026 | 7 468 588    |
| 0.500% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2028 | 7 455 916    |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2031 | 7 239 310    |
| 2.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2040 | 7 213 880    |
| 2.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2041 | 7 104 067    |
| 2.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2027 | 6 836 488    |
| 0.625% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2026 | 6 741 432    |
| 1.750% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2028 | 6 653 333    |
| 0.500% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/04/2024 | 6 047 946    |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2026 | 6 028 983    |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/04/2027 | 6 026 384    |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/10/2024 | 5 834 644    |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/04/2026 | 5 576 124    |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2024 | 5 395 864    |
| 0.750% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2042 | 5 279 790    |
| 0.750% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2028 | 5 222 403    |
| 2.000% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2026 | 5 140 515    |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/04/2025 | 5 121 279    |
| 0.250% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2050 | 4 972 024    |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/10/2025 | 4 922 893    |
| 1.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2044 | 4 590 928    |
| 0.250% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2029 | 4 476 545    |
| 1.625% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/10/2027 | 4 459 227    |
| 0.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2025 | 4 235 552    |
| 0.625% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2043 | 4 224 938    |
| 3.625% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/04/2028 | 3 694 715    |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/01/2030 | 3 596 316    |
| 1.000% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2049 | 3 325 239    |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/07/2030 | 3 324 520    |
| 3.375% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/04/2032 | 3 221 821    |
| 0.125% United States Treasury Inflation Indexed Bonds 15/02/2051 | 3 092 965    |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille                             | Coût USD     |
|--|--------------|
| 0.000% United States Treasury Bill 15/06/2023      | 22 886 810   |
| 0.000% United States Treasury Bill 01/06/2023      | 17 371 814   |
| 0.000% United States Treasury Bill 29/06/2023      | 17 306 754   |
| 0.000% United States Treasury Bill 22/06/2023      | 17 225 044   |
| 0.000% United States Treasury Bill 08/06/2023      | 17 059 210   |
| 0.000% United States Treasury Bill 02/05/2023      | 9 366 424    |
| 0.000% United States Treasury Bill 09/05/2023      | 8 562 091    |
| 2.875% United States Treasury Note/Bond 15/05/2032 | 8 257 831    |
| 0.000% United States Treasury Bill 16/05/2023      | 7 460 026    |
| 0.000% United States Treasury Bill 23/05/2023      | 7 453 205    |
| 1.875% United States Treasury Note/Bond 15/02/2032 | 6 709 977    |
| 2.750% United States Treasury Note/Bond 15/08/2032 | 6 490 418    |
| 0.000% United States Treasury Bill 13/06/2023      | 6 046 198    |
| 0.000% United States Treasury Bill 20/06/2023      | 6 039 826    |
| 0.000% United States Treasury Bill 27/06/2023      | 6 035 826    |
| 0.000% United States Treasury Bill 06/06/2023      | 5 952 446    |
| 4.125% United States Treasury Note/Bond 15/11/2032 | 5 367 100    |
| 2.625% United States Treasury Note/Bond 31/05/2027 | 5 300 687    |
| 2.750% United States Treasury Note/Bond 30/04/2027 | 4 486 795    |
| 2.500% United States Treasury Note/Bond 31/03/2027 | 4 202 852    |
| Ventes du Portefeuille                             | Produits USD |
| 0.000% United States Treasury Bill 20/04/2023      | 24 036 335   |
| 0.000% United States Treasury Bill 27/04/2023      | 18 081 002   |
| 0.000% United States Treasury Bill 13/04/2023      | 17 592 620   |
| 0.000% United States Treasury Bill 06/04/2023      | 16 602 770   |
| 0.000% United States Treasury Bill 11/04/2023      | 16 089 458   |
| 0.000% United States Treasury Bill 25/04/2023      | 16 029 108   |
| 0.000% United States Treasury Bill 18/04/2023      | 15 975 831   |
| 1.500% United States Treasury Note/Bond 29/02/2024 | 6 209 721    |
| 0.125% United States Treasury Note/Bond 15/08/2023 | 4 285 873    |
| 0.875% United States Treasury Note/Bond 31/01/2024 | 4 149 637    |
| 0.125% United States Treasury Note/Bond 15/02/2024 | 4 050 960    |
| 0.125% United States Treasury Note/Bond 15/01/2024 | 3 978 196    |
| 0.750% United States Treasury Note/Bond 31/12/2023 | 3 972 975    |
| 0.250% United States Treasury Note/Bond 30/09/2023 | 3 723 449    |
| 2.750% United States Treasury Note/Bond 15/11/2023 | 3 697 711    |
| 1.875% United States Treasury Note/Bond 15/02/2032 | 3 594 605    |
| 2.375% United States Treasury Note/Bond 15/05/2051 | 3 516 580    |
| 0.375% United States Treasury Note/Bond 31/10/2023 | 3 512 145    |
| 0.125% United States Treasury Note/Bond 31/08/2023 | 3 502 014    |
| 0.500% United States Treasury Note/Bond 30/11/2023 | 3 456 144    |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille                                  | Coût USD  |
|---|-----------|
| 3.875% United States Treasury Note/Bond 15/02/2043      | 3 021 328 |
| 2.000% French Republic Government Bond OAT 25/11/2032   | 2 533 058 |
| 3.625% United States Treasury Note/Bond 15/02/2053      | 1 686 601 |
| 4.400% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/05/2033     | 1 672 372 |
| 5.250% United States Treasury Note/Bond 15/11/2028      | 1 622 988 |
| 3.625% United States Treasury Note/Bond 31/03/2030      | 1 505 801 |
| 3.500% United States Treasury Note/Bond 31/01/2030      | 1 492 734 |
| 3.150% Spain Government Bond 30/04/2033                 | 1 284 966 |
| 5.000% United States Treasury Note/Bond 15/05/2037      | 1 165 820 |
| 2.900% Republic of Austria Government Bond 20/02/2033   | 1 082 713 |
| 2.200% Bundesobligation 13/04/2028                      | 1 079 638 |
| 2.500% Netherlands Government Bond 15/07/2033           | 1 072 163 |
| 4.125% United States Treasury Note/Bond 15/11/2032      | 1 050 469 |
| 3.500% United States Treasury Note/Bond 15/02/2033      | 1 000 605 |
| 1.800% Japan Government Thirty Year Bond 20/03/2043     | 851 792   |
| 5.500% Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 04/13/2053 | 757 910   |
| 5.000% Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 04/13/2053 | 748 184   |
| 3.600% Province of Quebec Canada 01/09/2033             | 734 474   |
| 1.000% Japan Government Forty Year Bond 20/03/2062      | 670 366   |
| 4.125% United Kingdom Gilt 29/01/2027                   | 501 015   |
| 5.000% Ginnie Mae 04/20/2053                            | 500 605   |
| 1.400% Japan Government Twenty Year Bond 20/12/2042     | 399 309   |
| 3.290% China Government Bond 23/05/2029                 | 383 662   |
| 0.500% Japan Government Ten Year Bond 20/12/2032        | 381 836   |



## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF (non audité) (suite)

| Ventes du Portefeuille                                | Produits USD |
|---|--------------|
| 0.250% United States Treasury Note/Bond 15/03/2024    | 2 878 828    |
| 2.250% United States Treasury Note/Bond 31/03/2024    | 2 442 480    |
| 2.880% China Government Bond 05/11/2023               | 2 373 710    |
| 0.000% French Republic Government Bond OAT 25/03/2024 | 2 057 202    |
| 2.570% China Government Bond 20/05/2023               | 1 456 063    |
| 2.360% China Government Bond 02/07/2023               | 1 425 157    |
| 0.100% Japan Government Five Year Bond 20/03/2024     | 1 392 845    |
| 2.125% United States Treasury Note/Bond 31/03/2024    | 1 268 617    |
| 2.560% China Government Bond 21/10/2023               | 1 132 152    |
| 3.030% China Government Bond 11/03/2026               | 1 122 333    |
| 3.020% China Government Bond 22/10/2025               | 1 116 671    |
| 0.000% Bundesschatzanweisungen 15/03/2024             | 952 050      |
| 2.680% China Government Bond 21/05/2030               | 839 310      |
| 4.500% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 01/03/2024   | 837 139      |
| 3.130% China Government Bond 21/11/2029               | 790 367      |
| 0.005% Japan Government Two Year Bond 01/05/2024      | 752 265      |
| 0.005% Japan Government Two Year Bond 01/04/2024      | 752 198      |
| 3.010% China Government Bond 13/05/2028               | 745 342      |
| 3.280% China Government Bond 03/12/2027               | 678 204      |
| 2.850% China Government Bond 04/06/2027               | 627 495      |
| 2.940% China Government Bond 17/10/2024               | 606 535      |
| 3.020% China Government Bond 27/05/2031               | 588 672      |
| 2.690% China Government Bond 12/08/2026               | 577 822      |
| 2.910% China Government Bond 14/10/2028               | 576 028      |
| 1.990% China Government Bond 09/04/2025               | 573 512      |
| 3.860% China Government Bond 22/07/2049               | 543 279      |
| 3.120% China Government Bond 05/12/2026               | 532 227      |
| 3.720% China Government Bond 12/04/2051               | 500 621      |
| 2.840% China Government Bond 08/04/2024               | 457 758      |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF (non-audité)

| Achats du Portefeuille                             | Coût EUR   |
|--|------------|
| 2.908% Goldman Sachs Group Inc 21/07/2042          | 10 070 633 |
| 5.375% Dominion Energy Inc 15/11/2032              | 8 383 164  |
| 3.375% Dominion Energy Inc 01/04/2030              | 6 317 990  |
| 2.300% AvalonBay Communities Inc 01/03/2030        | 3 476 759  |
| 4.900% Anheuser-Busch InBev Finance Inc 01/02/2046 | 3 177 141  |
| 3.088% Bank of Montreal 10/01/2037                 | 2 960 370  |
| 3.900% JPMorgan Chase & Co 15/07/2025              | 2 947 470  |
| 0.790% Morgan Stanley 30/05/2025                   | 2 840 220  |
| 4.200% GlaxoSmithKline Capital Inc 18/03/2043      | 2 714 250  |
| 4.625% Virginia Electric and Power Co 15/05/2052   | 2 711 900  |
| 6.900% Dow Chemical Co 15/05/2053                  | 2 303 360  |
| 5.500% Comcast Corp 15/11/2032                     | 2 130 200  |
| 5.400% Duke Energy Indiana LLC 01/04/2053          | 2 029 600  |
| 5.125% CVS Health Corp 21/02/2030                  | 2 023 080  |
| 5.000% AvalonBay Communities Inc 15/02/2033        | 2 022 940  |
| 4.625% Waste Management Inc 15/02/2030             | 1 996 760  |
| 4.800% Intel Corp 01/10/2041                       | 1 993 551  |
| 4.500% Medtronic Global Holdings SCA 30/03/2033    | 1 992 500  |
| 5.210% HSBC Holdings PLC 11/08/2028                | 1 979 420  |
| 2.900% AvalonBay Communities Inc 15/10/2026        | 1 884 420  |
| 4.175% Banco Santander SA 24/03/2028               | 1 872 840  |
| 2.534% Honda Motor Co Ltd 10/03/2027               | 1 872 300  |
| 4.875% Phillips 66 15/11/2044                      | 1 860 880  |
| 2.650% Bank of Montreal 08/03/2027                 | 1 844 380  |

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF (non audité) (suite)

| Ventes du Portefeuille                            | Produits EUR |
|---|--------------|
| 3.625% Cisco Systems Inc 04/03/2024               | 16 018 040   |
| 3.250% Unilever Capital Corp 07/03/2024           | 10 928 935   |
| 3.220% JPMorgan Chase & Co 01/03/2025             | 6 412 373    |
| 3.900% Lloyds Banking Group PLC 12/03/2024        | 5 108 219    |
| 3.600% Walt Disney Co 13/01/2051                  | 4 523 960    |
| 3.250% Toronto-Dominion Bank 11/03/2024           | 4 214 153    |
| 1.089% Santander UK Group Holdings PLC 15/03/2025 | 4 047 143    |
| 3.000% Goldman Sachs Group Inc 15/03/2024         | 3 907 000    |
| 4.000% Goldman Sachs Group Inc 03/03/2024         | 3 722 086    |
| 4.700% Walt Disney Co 23/03/2050                  | 3 301 808    |
| 4.269% NatWest Group PLC 22/03/2025               | 3 057 667    |
| 2.150% Bank of Montreal 08/03/2024                | 2 909 370    |
| 3.000% TWDC Enterprises 18 Corp 30/07/2046        | 2 698 632    |
| 0.900% AT&T Inc 25/03/2024                        | 2 392 575    |
| 5.500% Cisco Systems Inc 15/01/2040               | 2 167 860    |
| 4.125% TWDC Enterprises 18 Corp 01/06/2044        | 2 154 096    |
| 4.000% Santander UK PLC 13/03/2024                | 2 126 953    |
| 2.900% Merck & Co Inc 07/03/2024                  | 2 091 660    |
| 2.350% Toronto-Dominion Bank 08/03/2024           | 1 943 260    |
| 0.750% Verizon Communications Inc 22/03/2024      | 1 917 100    |
| 3.803% HSBC Holdings PLC 11/03/2025               | 1 857 079    |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille  | Coût USD     |
|---|--------------|
| 3.400% Novartis Capital Corp 06/05/2024                                 | 22 524 512   |
| 3.000% Novartis Capital Corp 20/11/2025                                 | 21 590 491   |
| 5.088% Australia & New Zealand Banking Group Ltd/New York NY 08/12/2025 | 20 791 745   |
| 3.250% Adobe Inc 01/02/2025   | 20 477 799   |
| 4.000% HP Inc 15/04/2029  | 16 855 928   |
| 5.862% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 14/09/2026                    | 16 142 300   |
| 2.000% Novartis Capital Corp 14/02/2027                                 | 15 535 980   |
| 5.500% HP Inc 15/01/2033  | 15 072 308   |
| 4.700% Bank of Montreal 14/09/2027                                      | 14 833 662   |
| 2.539% Baxter International Inc 01/02/2032                              | 14 292 753   |
| 2.200% Novartis Capital Corp 14/08/2030                                 | 13 736 086   |
| 5.500% Diageo Capital PLC 24/01/2033                                    | 12 558 373   |
| 6.138% Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 14/09/2028                    | 12 273 398   |
| 3.000% Apple Inc 09/02/2024   | 11 901 480   |
| 2.300% Adobe Inc 01/02/2030   | 11 748 677   |
| 4.200% HP Inc 15/04/2032  | 11 472 701   |
| 3.250% Colgate-Palmolive Co 15/08/2032                                  | 11 290 745   |
| 3.088% Bank of Montreal 10/01/2037                                      | 11 004 196   |
| 6.750% Boston Properties LP 01/12/2027                                  | 10 461 729   |
| 2.550% Boston Properties LP 01/04/2032                                  | 10 127 138   |
| Ventes du Portefeuille  | Produits USD |
| 5.250% Stellantis NV 15/04/2023   | 17 898 320   |
| 9.625% British Telecommunications PLC 15/12/2030                        | 17 076 190   |
| 0.625% Salesforce Inc 15/07/2024  | 17 075 765   |
| 3.000% Apple Inc 09/02/2024   | 16 174 671   |
| 4.338% Bank of Montreal 05/10/2028                                      | 14 593 219   |
| 4.100% Morgan Stanley 22/05/2023  | 14 399 240   |
| 4.500% CNH Industrial NV 15/08/2023                                     | 14 091 664   |
| 2.625% Diageo Capital PLC 29/04/2023                                    | 13 057 830   |
| 5.200% Rio Tinto Finance USA Ltd 02/11/2040                             | 13 017 810   |
| 2.400% Apple Inc 03/05/2023   | 12 104 993   |
| 3.375% Sanofi 19/06/2023  | 12 044 580   |
| 4.125% Rio Tinto Finance USA PLC 21/08/2042                             | 11 980 600   |
| 3.250% BNP Paribas SA 03/03/2023  | 11 750 872   |
| 0.375% Unilever Capital Corp 14/09/2023                                 | 10 723 894   |
| 5.250% Intesa Sanpaolo SpA 12/01/2024                                   | 9 864 242    |
| 3.750% WPP Finance 2010 19/09/2024                                      | 9 618 000    |
| 3.300% Bank of Montreal 05/02/2024                                      | 9 299 149    |
| 3.650% Campbell Soup Co 15/03/2023                                      | 8 492 797    |
| 3.024% GSK Consumer Healthcare Capital US LLC 24/03/2024                | 8 370 776    |
| 1.950% CNH Industrial Capital LLC 02/07/2023                            | 8 343 081    |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille   | Coût USD     |
|--|--------------|
| 3.875% Clarivate Science Holdings Corp 01/07/2028  | 2 920 938    |
| 4.250% Royal Caribbean Cruises Ltd 01/07/2026  | 2 594 275    |
| 2.875% Ball Corp 15/08/2030  | 2 258 290    |
| 7.000% Caesars Entertainment Inc 15/02/2030  | 1 518 412    |
| 3.742% Deutsche Bank AG/New York NY 07/01/2033   | 1 472 648    |
| 11.250% Sabre GBLB Inc 15/12/2027  | 1 449 859    |
| 6.000% Carnival Corp 01/05/2029  | 1 440 442    |
| 4.500% Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GCSI Sellco LL 01/04/2027 | 1 425 766    |
| 7.125% California Resources Corp 01/02/2026  | 1 418 492    |
| 3.375% HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC 15/06/2026   | 1 378 115    |
| 5.125% Mercer International Inc 01/02/2029   | 1 344 216    |
| 4.750% KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC 01/06/2027                   | 1 303 575    |
| 4.625% Chemours Co 15/11/2029  | 1 283 218    |
| 7.875% Bombardier Inc 15/04/2027   | 1 282 002    |
| 3.125% Ball Corp 15/09/2031  | 1 242 302    |
| 9.750% Diversified Healthcare Trust 15/06/2025   | 1 234 856    |
| 3.875% United Rentals North America Inc 15/02/2031   | 1 163 356    |
| 4.625% Victoria's Secret & Co 15/07/2029   | 1 141 460    |
| 5.875% Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc 15/08/2027                         | 1 138 487    |
| 8.125% Caesars Entertainment Inc 01/07/2027  | 1 133 410    |
| Ventes du Portefeuille   | Produits USD |
| 4.875% Deutsche Bank AG/New York NY 01/12/2032   | 1 925 802    |
| 5.500% Alcoa Nederland Holding BV 15/12/2027   | 1 680 000    |
| 4.250% Royal Caribbean Cruises Ltd 01/07/2026  | 1 460 892    |
| 2.875% Ball Corp 15/08/2030  | 1 402 034    |
| 3.742% Deutsche Bank AG/New York NY 07/01/2033   | 1 278 220    |
| 4.875% Ball Corp 15/03/2026  | 1 229 660    |
| 3.875% United Rentals North America Inc 15/02/2031   | 1 145 820    |
| 6.125% Alcoa Nederland Holding BV 15/05/2028   | 1 012 630    |
| 7.500% EQT Corp 01/02/2030   | 1 001 222    |
| 4.500% Deutsche Bank AG 01/04/2025   | 983 452      |
| 3.250% Vodafone Group PLC 04/06/2081   | 972 294      |
| 7.875% Bombardier Inc 15/04/2027   | 967 905      |
| 6.125% RR Donnelley & Sons Co 01/11/2026   | 940 150      |
| 6.250% Caesars Entertainment Inc 01/07/2025  | 934 078      |
| 4.625% Yum! Brands Inc 31/01/2032  | 923 368      |
| 4.125% Alcoa Nederland Holding BV 31/03/2029   | 901 417      |
| 4.250% Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp 01/02/2027               | 895 495      |
| 4.625% Centene Corp 15/12/2029   | 863 252      |
| 10.750% Staples Inc 15/04/2027   | 827 498      |
| 5.750% Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GCSI Sellco LL 15/05/2026 | 805 375      |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF (non audité)

| <b>Achats du Portefeuille</b>         | <b>Coût USD</b>     |
|---------------------------------------|---------------------|
| Equinix Inc                           | 13 918 083          |
| Prologis Inc                          | 5 961 314           |
| Public Storage                        | 2 990 064           |
| Realty Income                         | 2 445 373           |
| Simon Property Group                  | 2 091 761           |
| Welltower Inc                         | 1 961 078           |
| Digital Realty Trust Inc              | 1 800 484           |
| Alexandria Real Estate Equities Inc   | 1 479 297           |
| AvalonBay Communities                 | 1 470 880           |
| Equity Residential                    | 1 244 772           |
| Extra Space Storage Inc               | 1 243 102           |
| Mitsui Fudosan                        | 1 113 619           |
| WP Carey Inc                          | 1 077 311           |
| Invitation Homes Inc                  | 1 077 140           |
| Sun Communities Inc                   | 1 039 780           |
| Mid-America Apartment Communities Inc | 1 039 124           |
| Ventas Inc                            | 1 036 280           |
| Essex Property Trust Inc              | 865 320             |
| Link REIT                             | 863 919             |
| Healthpeak Properties Inc             | 809 496             |
| <b>Ventes du Portefeuille</b>         | <b>Produits USD</b> |
| Prologis Inc                          | 6 278 639           |
| Public Storage                        | 3 004 144           |
| Equinix Inc                           | 2 706 908           |
| Simon Property Group                  | 2 449 701           |
| Realty Income                         | 2 406 587           |
| Digital Realty Trust Inc              | 2 405 888           |
| Welltower Inc                         | 2 128 162           |
| AvalonBay Communities                 | 1 896 344           |
| Equity Residential                    | 1 780 964           |
| Extra Space Storage Inc               | 1 690 804           |
| Mitsui Fudosan                        | 1 478 314           |
| Alexandria Real Estate Equities Inc   | 1 475 254           |
| Mid-America Apartment Communities Inc | 1 402 588           |
| Ventas Inc                            | 1 400 192           |
| Duke Realty Corp                      | 1 368 270           |
| Invitation Homes Inc                  | 1 337 300           |
| Link REIT                             | 1 264 181           |
| Essex Property Trust Inc              | 1 165 107           |
| Sun Communities Inc                   | 1 154 299           |
| Segro PLC                             | 1 040 324           |
| WP Carey Inc                          | 1 001 327           |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF (non audité)

| <b>Achats du Portefeuille</b>       | <b>Coût EUR</b> |
|-------------------------------------|-----------------|
| Vonovia SE                          | 1 701 156       |
| Swiss Prime Site AG                 | 491 778         |
| Unibail-Rodamco-Westfield           | 458 253         |
| PSP Swiss Property AG               | 442 632         |
| VGP NV                              | 440 227         |
| Warehouses De Pauw CVA              | 436 213         |
| LEG Immobilien SE                   | 411 303         |
| Gecina SA                           | 377 937         |
| Aedifica SA                         | 346 115         |
| Kleipierre SA                       | 334 385         |
| Sagax AB                            | 305 732         |
| Castellum AB                        | 286 850         |
| Fastighets AB Balder                | 249 388         |
| Cofinimmo SA                        | 248 806         |
| ARGAN SA                            | 240 845         |
| Aroundtown SA                       | 238 085         |
| Kojamo Oyj                          | 228 122         |
| Merlin Properties Socimi SA         | 228 052         |
| Covivio                             | 227 819         |
| Mobimo Holding AG                   | 204 143         |
| Inmobiliaria Colonial Socimi SA     | 197 502         |
| Fabege AB                           | 182 315         |
| Allreal Holding AG                  | 178 515         |
| Wihlborgs Fastigheter AB            | 166 745         |
| Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB | 159 006         |
| TAG Immobilien AG                   | 156 186         |
| Catena AB                           | 150 629         |
| DIC Asset AG                        | 145 147         |
| Montea NV                           | 131 830         |
| Mercialys SA                        | 130 909         |
| Carmila SA                          | 127 276         |
| Hufvudstaden AB                     | 122 801         |

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF (non audité) (suite)

| Ventes du Portefeuille              | Produits EUR |
|-------------------------------------|--------------|
| Vonovia SE                          | 2 979 659    |
| Aroundtown SA                       | 703 569      |
| Swiss Prime Site AG                 | 689 991      |
| Unibail-Rodamco-Westfield           | 627 574      |
| LEG Immobilien SE                   | 610 401      |
| Gecina SA                           | 554 423      |
| Warehouses De Pauw CVA              | 485 307      |
| PSP Swiss Property AG               | 480 563      |
| Castellum AB                        | 441 396      |
| Klepierre SA                        | 402 550      |
| Sagax AB                            | 398 136      |
| Befimmo SA                          | 373 207      |
| Deutsche EuroShop AG                | 365 764      |
| Aedifica SA                         | 361 475      |
| Cofinimmo SA                        | 355 669      |
| Merlin Properties Socimi SA         | 340 616      |
| Kojamo Oyj                          | 336 482      |
| Fastighets AB Balder                | 336 387      |
| Covivio                             | 309 950      |
| Fabege AB                           | 285 514      |
| Inmobiliaria Colonial Socimi SA     | 268 324      |
| Allreal Holding AG                  | 251 516      |
| TAG Immobilien AG                   | 231 787      |
| Wihlborgs Fastigheter AB            | 211 194      |
| Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB | 191 205      |
| Mobimo Holding AG                   | 180 965      |
| ICADE                               | 174 366      |
| Nyfosa AB                           | 167 420      |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.



## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF (non audité)

| <b>Achats du Portefeuille</b>   | <b>Coût GBP</b>     |
|---------------------------------|---------------------|
| Shell PLC                       | 5 297 130           |
| AstraZeneca PLC                 | 4 941 715           |
| HSBC Holdings PLC               | 3 532 167           |
| Unilever PLC                    | 3 029 955           |
| Reckitt Benckiser Group PLC     | 2 781 421           |
| Diageo PLC                      | 2 584 060           |
| BP PLC                          | 2 494 289           |
| Glencore PLC                    | 2 226 453           |
| British American Tobacco PLC    | 2 195 993           |
| RELX PLC                        | 1 897 401           |
| Rio Tinto PLC                   | 1 859 213           |
| London Stock Exchange Group PLC | 1 609 220           |
| GSK PLC                         | 1 473 080           |
| National Grid PLC               | 1 357 487           |
| Rentokil Initial PLC            | 1 279 707           |
| Anglo American PLC              | 1 213 466           |
| Vodafone Group PLC              | 1 165 669           |
| Compass Group PLC               | 1 099 266           |
| Prudential PLC                  | 1 010 376           |
| CRH PLC                         | 936 483             |
| Lloyds Banking Group PLC        | 912 686             |
| <b>Ventes du Portefeuille</b>   | <b>Produits GBP</b> |
| Shell PLC                       | 5 907 825           |
| Ferguson PLC                    | 5 573 612           |
| AstraZeneca PLC                 | 5 135 563           |
| BP PLC                          | 2 966 857           |
| HSBC Holdings PLC               | 2 778 314           |
| Unilever PLC                    | 2 475 792           |
| Diageo PLC                      | 2 155 972           |
| British American Tobacco PLC    | 1 664 396           |
| Glencore PLC                    | 1 523 923           |
| Rio Tinto PLC                   | 1 471 557           |
| Vodafone Group PLC              | 1 424 431           |
| GSK PLC                         | 1 179 188           |
| RELX PLC                        | 1 154 192           |
| Reckitt Benckiser Group PLC     | 1 001 457           |
| National Grid PLC               | 935 124             |
| Lloyds Banking Group PLC        | 839 817             |
| Anglo American PLC              | 829 576             |
| Compass Group PLC               | 800 155             |
| Prudential PLC                  | 770 679             |
| Bardays PLC                     | 745 424             |
| CRH PLC                         | 730 637             |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR MSCI ACWI UCITS ETF (non audité)

| <b>Achats du Portefeuille</b>             | <b>Coût USD</b>     |
|---|---------------------|
| Apple Inc                                 | 15 103 997          |
| Microsoft Corp                            | 12 441 997          |
| Amazon.com Inc                            | 6 768 022           |
| Tesla Inc                                 | 4 674 379           |
| Alphabet Inc                              | 4 413 367           |
| Alphabet Inc                              | 3 955 418           |
| UnitedHealth Group Inc                    | 3 409 555           |
| NVIDIA Corp                               | 3 345 704           |
| Johnson & Johnson                         | 3 303 919           |
| Tencent Holdings Ltd                      | 3 294 893           |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 2 839 361           |
| Meta Platforms Inc                        | 2 802 296           |
| Exxon Mobil Corp                          | 2 676 978           |
| AbbVie Inc                                | 2 436 173           |
| JPMorgan Chase & Co                       | 2 333 882           |
| Visa Inc                                  | 2 255 850           |
| Home Depot Inc                            | 2 107 352           |
| Eli Lilly & Co                            | 2 037 583           |
| Procter & Gamble Co                       | 1 956 858           |
| Mastercard Inc                            | 1 955 718           |
| <b>Ventes du Portefeuille</b>             | <b>Produits USD</b> |
| Apple Inc                                 | 28 166 994          |
| Microsoft Corp                            | 20 675 484          |
| Amazon.com Inc                            | 11 119 149          |
| Alphabet Inc                              | 8 407 270           |
| Alphabet Inc                              | 7 099 853           |
| Tesla Inc                                 | 6 355 243           |
| UnitedHealth Group Inc                    | 5 857 979           |
| Meta Platforms Inc                        | 5 345 562           |
| NVIDIA Corp                               | 5 005 739           |
| Johnson & Johnson                         | 4 825 591           |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 4 752 087           |
| Exxon Mobil Corp                          | 4 603 560           |
| Nestle SA                                 | 4 431 013           |
| Visa Inc                                  | 4 071 967           |
| JPMorgan Chase & Co                       | 4 050 079           |
| Home Depot Inc                            | 3 903 539           |
| Mastercard Inc                            | 3 733 177           |
| Eli Lilly & Co                            | 3 580 012           |
| Procter & Gamble Co                       | 3 486 902           |
| AbbVie Inc                                | 3 485 792           |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF (non audité)

| <b>Achats du Portefeuille</b>              | <b>Coût USD</b>     |
|--|---------------------|
| Tencent Holdings Ltd                       | 5 020 783           |
| Kuaishou Technology                        | 2 510 470           |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd  | 2 050 234           |
| Meituan                                    | 1 963 517           |
| KE Holdings Inc                            | 1 493 712           |
| Reliance Industries Ltd                    | 1 353 192           |
| GCL Technology Holdings Ltd                | 1 233 389           |
| PDD Holdings Inc                           | 1 230 805           |
| LG Energy Solution Ltd                     | 1 180 333           |
| JD.com Inc                                 | 1 143 253           |
| Samsung Electronics Co Ltd                 | 1 140 981           |
| Powerchip Semiconductor Manufacturing Corp | 1 039 903           |
| JD Health International Inc                | 996 155             |
| Alibaba Group Holding Ltd                  | 989 882             |
| Tsingtao Brewery Co Ltd                    | 817 947             |
| Bilibili Inc                               | 809 188             |
| Tata Elxsi Ltd                             | 802 532             |
| Orient Overseas International Ltd          | 792 395             |
| China Construction Bank Corp               | 789 503             |
| Adani Power Ltd                            | 756 629             |
| <b>Ventes du Portefeuille</b>              | <b>Produits USD</b> |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd  | 2 523 402           |
| Alibaba Group Holding Ltd                  | 1 511 009           |
| Samsung Electronics Co Ltd                 | 1 313 287           |
| Tencent Holdings Ltd                       | 912 545             |
| Bilibili Inc                               | 776 253             |
| HCL Technologies Ltd                       | 759 474             |
| Wharf Holdings Ltd                         | 694 680             |
| Bharti Airtel Ltd                          | 655 370             |
| Meituan                                    | 562 474             |
| Bajaj Auto Ltd                             | 561 892             |
| Maruti Suzuki India Ltd                    | 552 628             |
| GDS Holdings Ltd                           | 537 434             |
| NetEase Inc                                | 526 865             |
| China Construction Bank Corp               | 512 837             |
| China Merchants Bank Co Ltd                | 500 119             |
| Fubon Financial Holding Co Ltd             | 495 138             |
| Beijing-Shanghai High Speed Railway Co Ltd | 492 729             |
| KE Holdings Inc                            | 477 710             |
| ICICI Bank Ltd                             | 464 184             |
| Foxconn Technology Co Ltd                  | 408 184             |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR MSCI EMU UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille              | Coût EUR |
|-------------------------------------|----------|
| LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 618 020  |
| ASML Holding NV                     | 568 982  |
| Dr. Ing. h.c. F.Porsche AG          | 536 432  |
| Bank of Ireland Group PLC           | 446 817  |
| TotalEnergies SE                    | 443 666  |
| Sanofi                              | 354 827  |
| Iberdrola SA                        | 351 531  |
| Metso Outotec Oyj                   | 344 039  |
| Siemens AG                          | 321 637  |
| Stellantis NV                       | 258 913  |
| Rheinmetall AG                      | 252 009  |
| SAP SE                              | 247 098  |
| Schneider Electric SE               | 243 724  |
| L'Oreal SA                          | 241 853  |
| Air Liquide SA                      | 241 730  |
| Adyen NV                            | 238 487  |
| Allianz SE                          | 229 908  |
| Argenx SE                           | 224 913  |
| Airbus                              | 192 943  |
| Cellnex Telecom SA                  | 192 118  |
| BNP Paribas SA                      | 188 435  |
| Vinci SA                            | 182 372  |
| AIB Group PLC                       | 176 044  |
| Warehouses De Pauw CVA              | 174 691  |
| Anheuser-Busch InBev SA/NV          | 174 169  |

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR MSCI EMU UCITS ETF (non audité) (suite)

| Ventes du Portefeuille              | Produits EUR |
|-------------------------------------|--------------|
| ASML Holding NV                     | 1 941 866    |
| LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | 1 773 254    |
| TotalEnergies SE                    | 1 102 242    |
| SAP SE                              | 934 907      |
| Siemens AG                          | 902 132      |
| Sanofi                              | 823 008      |
| L'Oreal SA                          | 817 726      |
| Allianz SE                          | 678 314      |
| Schneider Electric SE               | 644 290      |
| Prosus NV                           | 627 471      |
| Air Liquide SA                      | 623 427      |
| Iberdrola SA                        | 606 774      |
| Mercedes-Benz Group AG              | 583 459      |
| Airbus                              | 565 460      |
| Deutsche Telekom AG                 | 556 790      |
| AXA SA                              | 521 328      |
| BNP Paribas SA                      | 501 192      |
| Banco Santander SA                  | 493 515      |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA  | 479 178      |
| Bayer AG                            | 456 514      |
| Vinci SA                            | 455 127      |
| Hermès International                | 442 709      |
| ING Groep NV                        | 421 347      |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR MSCI Japan UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille              | Coût JPY    |
|-------------------------------------|-------------|
| Toyota Motor                        | 369 966 729 |
| Sony                                | 246 581 184 |
| Keyence                             | 179 334 493 |
| Recruit Holdings Co Ltd             | 155 027 585 |
| Mitsubishi UFJ Financial Group Inc  | 153 318 279 |
| Shin-Etsu Chemical Co Ltd           | 150 413 459 |
| Tokyo Electron Ltd                  | 135 643 267 |
| SoftBank Group                      | 118 687 892 |
| Japan Post Bank Co Ltd              | 115 510 005 |
| Nintendo Co Ltd                     | 110 727 121 |
| KDDI Corp                           | 110 276 220 |
| Daiichi Sankyo Co Ltd               | 100 389 507 |
| Hitachi Ltd                         | 99 485 104  |
| Takeda Pharmaceutical Co Ltd        | 96 971 701  |
| Honda Motor Co Ltd                  | 93 994 038  |
| Mitsubishi Corp                     | 92 910 413  |
| Daikin Industries Ltd               | 90 214 281  |
| Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | 89 864 065  |
| ITOCHU Corp                         | 85 022 156  |
| Olympus                             | 84 935 681  |
| Mitsui & Co Ltd                     | 81 830 357  |
| Hoya Corp                           | 78 570 707  |

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR MSCI Japan UCITS ETF (non audité) (suite)

| Ventes du Portefeuille             | Produits JPY |
|------------------------------------|--------------|
| Toyota Motor                       | 55 355 706   |
| Mitsui & Co Ltd                    | 47 371 545   |
| Sony                               | 36 073 321   |
| Takeda Pharmaceutical Co Ltd       | 28 138 835   |
| Keyence                            | 26 780 220   |
| Orix JREIT Inc                     | 25 489 212   |
| Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | 25 119 910   |
| Advantest Corp                     | 24 632 023   |
| Toyo Suisan Kaisha Ltd             | 24 114 642   |
| Tsuruha Holdings Inc               | 24 068 211   |
| Shin-Etsu Chemical Co Ltd          | 23 148 669   |
| Rinnai Corp                        | 22 969 860   |
| Sohgo Security Services Co Ltd     | 22 870 338   |
| Ryohin Keikaku Co Ltd              | 22 502 357   |
| Lion Corp                          | 21 799 296   |
| Stanley Electric Co Ltd            | 21 778 216   |
| Mitsubishi Corp                    | 21 125 869   |
| Tokyo Electron Ltd                 | 20 364 458   |
| Santen Pharmaceutical Co Ltd       | 20 127 165   |
| Medipal Holdings Corp              | 19 830 289   |
| Miura Co Ltd                       | 19 179 389   |
| Renesas Electronics Corp           | 18 512 589   |
| KDDI Corp                          | 17 734 596   |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR MSCI World UCITS ETF (non audité)

| <b>Achats du Portefeuille</b> | <b>Coût USD</b>     |
|-------------------------------|---------------------|
| Apple Inc                     | 43 543 728          |
| Microsoft Corp                | 32 439 852          |
| Amazon.com Inc                | 19 220 435          |
| Tesla Inc                     | 12 118 167          |
| Alphabet Inc                  | 11 449 713          |
| Alphabet Inc                  | 10 860 076          |
| UnitedHealth Group Inc        | 8 496 982           |
| Johnson & Johnson             | 8 119 131           |
| NVIDIA Corp                   | 7 804 621           |
| Exxon Mobil Corp              | 7 340 533           |
| Meta Platforms Inc            | 6 945 979           |
| Berkshire Hathaway Inc        | 6 918 865           |
| JPMorgan Chase & Co           | 6 405 331           |
| Procter & Gamble Co           | 6 155 586           |
| Visa Inc                      | 6 136 412           |
| Nestle SA                     | 5 750 972           |
| Chevron Corp                  | 5 459 215           |
| Home Depot Inc                | 5 355 838           |
| Mastercard Inc                | 5 175 059           |
| AbbVie Inc                    | 4 977 202           |
| <b>Ventes du Portefeuille</b> | <b>Produits USD</b> |
| Apple Inc                     | 3 431 284           |
| Microsoft Corp                | 1 991 392           |
| Meta Platforms Inc            | 1 276 665           |
| Alphabet Inc                  | 1 180 259           |
| Amazon.com Inc                | 1 027 535           |
| Exxon Mobil Corp              | 720 969             |
| Shell PLC                     | 703 644             |
| Occidental Petroleum Corp     | 681 177             |
| Alphabet Inc                  | 680 524             |
| ABIOMED Inc                   | 669 126             |
| Morgan Stanley                | 628 192             |
| Steel Dynamics Inc            | 567 165             |
| ASML Holding NV               | 559 378             |
| HCA Healthcare Inc            | 547 418             |
| UnitedHealth Group Inc        | 531 026             |
| NVR Inc                       | 511 739             |
| Johnson & Johnson             | 511 312             |
| Novo Nordisk A/S              | 501 353             |
| Tesla Inc                     | 484 672             |
| Nestle SA                     | 446 744             |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.



## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF (non audité)

| <b>Achats du Portefeuille</b>        | <b>Coût USD</b>     |
|--------------------------------------|---------------------|
| Antero Resources Corp                | 7 918 934           |
| CubeSmart                            | 7 509 619           |
| Aramark                              | 6 758 071           |
| Dynatrace Inc                        | 6 753 471           |
| Fortune Brands Innovations Inc       | 6 028 556           |
| Nexstar Media Group Inc              | 5 951 619           |
| Matador Resources Co                 | 5 835 839           |
| Shockwave Medical Inc                | 5 611 887           |
| Southwestern Energy Co               | 5 560 210           |
| US Foods Holding Corp                | 5 529 356           |
| Annaly Capital Management Inc        | 5 488 403           |
| Autoliv Inc                          | 5 225 474           |
| Agree Realty Corp                    | 5 128 944           |
| Fair Isaac Corp                      | 4 853 409           |
| Axalta Coating Systems Ltd           | 4 734 925           |
| Frontier Communications Parent Inc   | 4 541 595           |
| Novanta Inc                          | 4 464 126           |
| Rexford Industrial Realty Inc        | 4 396 391           |
| Carlisle Cos Inc                     | 4 326 395           |
| First Horizon Corp                   | 4 280 054           |
| <b>Ventes du Portefeuille</b>        | <b>Produits USD</b> |
| Fair Isaac Corp                      | 14 593 519          |
| Steel Dynamics Inc                   | 12 868 437          |
| Camden Property Trust                | 10 139 988          |
| First Solar Inc                      | 10 020 800          |
| Targa Resources Corp                 | 9 305 385           |
| EQT Corp                             | 9 053 132           |
| Builders FirstSource Inc             | 2 925 520           |
| Ritchie Bros Auctioneers Inc         | 2 880 747           |
| Dycom Industries Inc                 | 2 551 177           |
| Tandem Diabetes Care Inc             | 2 510 289           |
| Viasat Inc                           | 2 343 236           |
| Cracker Barrel Old Country Store Inc | 2 282 263           |
| Avis Budget Group Inc                | 2 226 174           |
| Reliance Steel & Aluminum Co         | 2 064 874           |
| Service Corp International/US        | 1 943 047           |
| Carlisle Cos Inc                     | 1 902 151           |
| Kennametal Inc                       | 1 821 079           |
| Hanesbrands Inc                      | 1 797 568           |
| Washington Federal Inc               | 1 778 224           |
| Hubbell Inc                          | 1 714 791           |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF\* (non audité)

| <b>Achats du Portefeuille</b> | <b>Coût USD</b>     |
|-------------------------------|---------------------|
| Apple Inc                     | 42 605 956          |
| Microsoft Corp                | 40 034 491          |
| Amazon.com Inc                | 19 678 377          |
| NVIDIA Corp                   | 17 576 130          |
| Alphabet Inc                  | 13 569 865          |
| UnitedHealth Group Inc        | 12 437 213          |
| Alphabet Inc                  | 12 281 597          |
| JPMorgan Chase & Co           | 11 383 003          |
| Exxon Mobil Corp              | 10 599 677          |
| Visa Inc                      | 10 154 132          |
| Procter & Gamble Co           | 9 319 021           |
| AbbVie Inc                    | 8 428 788           |
| Bank of America Corp          | 7 723 679           |
| Eli Lilly & Co                | 7 060 902           |
| Coca-Cola                     | 6 678 012           |
| Merck & Co Inc                | 6 659 189           |
| PepsiCo                       | 6 501 536           |
| Walt Disney Co                | 6 492 507           |
| Cisco Systems Inc             | 6 254 904           |
| Salesforce Inc                | 5 863 498           |
| Adobe Inc                     | 5 673 503           |
| AT&T Inc                      | 5 548 424           |
| Abbott Laboratories           | 5 308 145           |
| Walmart Inc                   | 5 267 156           |
| <b>Ventes du Portefeuille</b> | <b>Produits USD</b> |
| Apple Inc                     | 12 078 819          |
| Tesla Inc                     | 9 727 720           |
| Microsoft Corp                | 9 595 239           |
| Berkshire Hathaway Inc        | 8 996 559           |
| Johnson & Johnson             | 7 332 707           |
| Meta Platforms Inc            | 6 894 363           |
| Chevron Corp                  | 4 953 937           |
| Home Depot Inc                | 4 670 086           |
| NVIDIA Corp                   | 4 595 909           |
| Mastercard Inc                | 4 461 880           |
| Pfizer Inc                    | 4 370 042           |
| Amazon.com Inc                | 4 222 508           |
| Broadcom Inc                  | 3 675 443           |
| Costco Wholesale Corp         | 3 411 397           |
| Alphabet Inc                  | 3 372 868           |
| Thermo Fisher Scientific      | 3 256 501           |
| Alphabet Inc                  | 2 904 917           |
| Exxon Mobil Corp              | 2 799 371           |
| Accenture PLC                 | 2 794 990           |
| Bristol-Myers Squibb Co       | 2 618 384           |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant la période financière peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

\* Le nom du Compartiment a changé le 11 mai 2022. Se reporter à la Note 17.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR S&P 500 UCITS ETF (non audité)

| <b>Achats du Portefeuille</b> | <b>Coût USD</b>     |
|-------------------------------|---------------------|
| Apple Inc                     | 56 856 433          |
| Microsoft Corp                | 49 409 214          |
| Amazon.com Inc                | 27 645 592          |
| Tesla Inc                     | 22 862 180          |
| Alphabet Inc                  | 15 814 110          |
| Berkshire Hathaway Inc        | 14 047 732          |
| Alphabet Inc                  | 13 997 712          |
| UnitedHealth Group Inc        | 12 345 217          |
| Johnson & Johnson             | 11 467 592          |
| NVIDIA Corp                   | 11 236 303          |
| Exxon Mobil Corp              | 10 678 705          |
| JPMorgan Chase & Co           | 9 757 238           |
| Meta Platforms Inc            | 9 064 262           |
| Visa Inc                      | 8 892 075           |
| Procter & Gamble Co           | 8 478 421           |
| Chevron Corp                  | 8 393 189           |
| Home Depot Inc                | 7 631 379           |
| Mastercard Inc                | 7 214 715           |
| Broadcom Inc                  | 7 123 985           |
| Pfizer Inc                    | 7 030 825           |
| <b>Ventes du Portefeuille</b> | <b>Produits USD</b> |
| Apple Inc                     | 99 948 357          |
| Microsoft Corp                | 76 692 301          |
| Amazon.com Inc                | 38 210 015          |
| Alphabet Inc                  | 26 839 173          |
| Alphabet Inc                  | 24 444 814          |
| Berkshire Hathaway Inc        | 22 611 219          |
| Tesla Inc                     | 22 362 445          |
| UnitedHealth Group Inc        | 19 872 461          |
| Exxon Mobil Corp              | 18 272 236          |
| Johnson & Johnson             | 17 962 125          |
| NVIDIA Corp                   | 16 936 146          |
| Chevron Corp                  | 16 559 397          |
| Meta Platforms Inc            | 14 974 827          |
| JPMorgan Chase & Co           | 14 771 085          |
| Visa Inc                      | 14 290 104          |
| Procter & Gamble Co           | 13 712 470          |
| Home Depot Inc                | 13 105 470          |
| Mastercard Inc                | 12 186 979          |
| Eli Lilly & Co                | 10 745 743          |
| Pfizer Inc                    | 10 526 386          |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille               | Coût USD  |
|--------------------------------------|-----------|
| Altria Group Inc                     | 3 794 618 |
| CVS Health Corp                      | 3 685 267 |
| Raytheon Technologies Corp           | 3 403 167 |
| Kraft Heinz Co                       | 3 239 360 |
| Keurig Dr Pepper Inc                 | 3 105 352 |
| Loews Corp                           | 3 017 125 |
| W. R. Berkley                        | 3 013 716 |
| AmerisourceBergen Corp               | 2 981 182 |
| Travelers Cos Inc                    | 2 962 901 |
| Jack Henry & Associates Inc          | 2 839 618 |
| Chubb Ltd                            | 2 785 823 |
| McKesson Corp                        | 2 780 618 |
| International Business Machines Corp | 2 723 243 |
| Genuine Parts Co                     | 2 711 748 |
| Camden Property Trust                | 2 693 364 |
| CME Group Inc                        | 2 591 136 |
| Pinnacle West Capital Corp           | 2 561 794 |
| Merck & Co Inc                       | 2 558 529 |
| Progressive                          | 2 515 946 |
| Cboe Global Markets Inc              | 2 504 422 |
| American Water Works Co Inc          | 2 496 501 |
| Quest Diagnostics                    | 2 492 827 |
| IDEX Corp                            | 2 404 456 |
| Abbott Laboratories                  | 2 397 559 |
| J M Smucker Co                       | 2 370 880 |
| Verisk Analytics Inc                 | 2 323 252 |
| Nasdaq Inc                           | 2 301 256 |
| Hologic                              | 2 278 475 |
| Leidos Holdings Inc                  | 2 250 485 |

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF (non audité) (suite)

| Ventes du Portefeuille                | Produits USD |
|---------------------------------------|--------------|
| Public Storage                        | 3 856 578    |
| Walmart Inc                           | 2 981 453    |
| Progressive                           | 2 965 355    |
| Edison International                  | 2 877 371    |
| Nasdaq Inc                            | 2 815 928    |
| Air Products and Chemicals Inc        | 2 759 706    |
| Gilead Sciences Inc                   | 2 666 504    |
| Amcor PLC                             | 2 653 494    |
| AvalonBay Communities                 | 2 622 565    |
| J M Smucker Co                        | 2 582 054    |
| IDEX Corp                             | 2 581 770    |
| American Water Works Co Inc           | 2 563 551    |
| Mid-America Apartment Communities Inc | 2 562 288    |
| Camden Property Trust                 | 2 515 188    |
| Equity Residential                    | 2 509 991    |
| Union Pacific                         | 2 444 451    |
| Lockheed Martin Corp                  | 2 369 796    |
| CME Group Inc                         | 2 292 771    |
| Assurant Inc                          | 2 252 610    |
| Altria Group Inc                      | 2 247 724    |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille                             | Coût USD  |
|--|-----------|
| Realtek Semiconductor Corp                         | 7 062 008 |
| Woori Financial Group Inc                          | 4 948 143 |
| Vanguard International Semiconductor Corp          | 4 488 608 |
| PetroChina Co Ltd                                  | 4 216 649 |
| NH Investment & Securities Co Ltd                  | 4 215 536 |
| Parade Technologies Ltd                            | 3 818 633 |
| GS Engineering & Construction Corp                 | 3 760 388 |
| Tofas Turk Otomobil Fabrikasi AS                   | 3 701 842 |
| Saudi Telecom Co                                   | 3 574 716 |
| Zhen Ding Technology Holding Ltd                   | 3 531 311 |
| Samsung Securities Co Ltd                          | 3 453 578 |
| Longfor Group Holdings Ltd                         | 3 443 238 |
| SinoPac Financial Holdings Co Ltd                  | 3 320 434 |
| Radiant Opto-Electronics Corp                      | 3 261 374 |
| Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii AS          | 2 842 344 |
| China Construction Bank Corp                       | 2 762 055 |
| Samsung Card Co Ltd                                | 2 741 479 |
| Korea Investment Holdings Co Ltd                   | 2 683 961 |
| Wistron Corp                                       | 2 660 685 |
| Postal Savings Bank of China Co Ltd                | 2 593 342 |
| Arca Continental SAB de CV                         | 2 561 109 |
| Shinhan Financial Group Co Ltd                     | 2 475 766 |
| China Railway Group Ltd                            | 2 444 158 |
| People's Insurance Co Group of China Ltd           | 2 399 709 |
| King's Town Bank Co Ltd                            | 2 179 857 |
| Tripod Technology Corp                             | 2 154 634 |
| Guangdong Investment Ltd                           | 2 067 414 |
| Kumho Petrochemical Co Ltd                         | 2 063 400 |
| China Resources Gas Group Ltd                      | 1 946 150 |
| Greentown China Holdings Ltd                       | 1 942 390 |
| Yankuang Energy Group Co Ltd                       | 1 914 328 |
| Ratch Group PCL                                    | 1 892 124 |
| International Games System Co Ltd                  | 1 837 908 |
| Coca-Cola Femsa SAB de CV Unit NPV                 | 1 835 050 |
| SK Inc   | 1 827 682 |
| Lenovo Group Ltd                                   | 1 804 412 |
| Yuexiu Property Co Ltd                             | 1 797 176 |
| Costamare Inc                                      | 1 765 320 |
| Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV | 1 726 279 |
| China Conch Venture Holdings Ltd                   | 1 642 360 |
| Bosideng International Holdings Ltd                | 1 588 604 |
| New China Life Insurance Co Ltd                    | 1 576 523 |
| China Suntien Green Energy Corp Ltd                | 1 509 830 |
| Petronas Gas Bhd                                   | 1 497 261 |
| KT&G Corp  | 1 476 664 |

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF (non audité) (suite)

| Ventes du Portefeuille                             | Produits USD |
|--|--------------|
| Hypera SA  | 5 167 756    |
| Samsung Securities Co Ltd                          | 5 055 973    |
| NH Investment & Securities Co Ltd                  | 5 031 993    |
| China Overseas Land & Investment                   | 4 608 425    |
| Korea Investment Holdings Co Ltd                   | 4 444 560    |
| Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii AS          | 4 320 900    |
| Anhui Conch Cement Co Ltd                          | 4 001 904    |
| Ratch Group PCL                                    | 3 759 587    |
| China National Building Material Co Ltd            | 3 689 961    |
| Aldar Properties PJSC                              | 3 339 170    |
| Radiant Opto-Electronics Corp                      | 3 191 592    |
| Bosideng International Holdings Ltd                | 3 123 689    |
| ITEQ Corp  | 3 112 698    |
| Samsung Card Co Ltd                                | 2 993 582    |
| SITC International Holdings Co Ltd                 | 2 916 126    |
| Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV | 2 874 081    |
| First Abu Dhabi Bank PJSC                          | 2 792 867    |
| Coca-Cola Femsa SAB de CV Unit NPV                 | 2 708 310    |
| Tripod Technology Corp                             | 2 658 355    |
| King's Town Bank Co Ltd                            | 2 605 188    |
| Posco International Corp                           | 2 573 421    |
| Lenovo Group Ltd                                   | 2 445 868    |
| Yankuang Energy Group Co Ltd                       | 2 286 400    |
| Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd        | 2 069 327    |
| Wistron Corp                                       | 2 058 868    |
| KT&G Corp  | 2 058 582    |
| Globe Telecom Inc                                  | 2 003 310    |
| Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd            | 1 835 014    |
| People's Insurance Co Group of China Ltd           | 1 806 849    |
| Hellenic Telecommunications Organization SA        | 1 492 019    |
| Ping An Insurance Group Co of China Ltd            | 1 469 129    |
| Meritz Securities Co Ltd                           | 1 435 270    |
| Guangdong Investment Ltd                           | 1 413 902    |
| LG Uplus Corp                                      | 1 413 000    |
| Petronas Gas Bhd                                   | 1 388 559    |
| New China Life Insurance Co Ltd                    | 1 291 109    |
| Shinhan Financial Group Co Ltd                     | 1 179 143    |
| China Lesso Group Holdings Ltd                     | 1 170 441    |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF (non audité)

| <b>Achats du Portefeuille</b>                             | <b>Coût EUR</b> |
|---|-----------------|
| Solvay SA   | 52 446 407      |
| BASF SE   | 51 357 100      |
| Smurfit Kappa Group PLC                                   | 40 897 769      |
| Warehouses De Pauw CVA                                    | 31 386 304      |
| Wolters Kluwer NV   | 29 660 904      |
| Hannover Rueck SE   | 28 322 186      |
| Buzzi Unicem SpA  | 26 401 867      |
| Kone Oyj  | 23 071 037      |
| Deutsche Post AG  | 20 502 688      |
| GEA Group AG  | 20 342 875      |
| Enagas SA   | 18 800 038      |
| Bouygues SA   | 18 675 200      |
| Brenntag SE   | 16 503 945      |
| Elisa Oyj   | 16 503 148      |
| UPM-Kymmene Oyj   | 16 446 123      |
| EDP - Energias de Portugal                                | 15 843 667      |
| Koninklijke DSM NV  | 15 234 627      |
| Ageas SA/NV   | 14 723 740      |
| Allianz SE  | 14 557 470      |
| Wendel SE   | 14 507 431      |
| Wienerberger AG   | 14 203 955      |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 13 917 437      |
| Sanofi  | 12 848 338      |
| CRH PLC   | 12 372 793      |
| Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA            | 12 372 125      |
| Hera SpA  | 11 954 571      |
| Glanbia PLC   | 11 406 210      |
| Huhtamaki Oyj   | 10 216 704      |
| Etablissements Franz Colruyt NV                           | 9 938 863       |
| Koninklijke Vopak NV                                      | 9 188 975       |
| Legrand SA  | 9 038 854       |
| FUCHS PETROLUB SE   | 8 741 596       |
| ERG SpA   | 8 442 308       |
| Schneider Electric SE                                     | 8 222 844       |
| Air Liquide SA  | 8 147 092       |
| Fresenius SE & Co KGaA                                    | 7 487 162       |
| CANCOM SE   | 7 216 944       |



## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF (non audité) (suite)

| Ventes du Portefeuille                                    | Produits EUR |
|---|--------------|
| Fortum Oyj  | 43 818 931   |
| UPM-Kymmene Oyj   | 28 995 650   |
| Wolters Kluwer NV   | 27 312 401   |
| Sanofi  | 27 181 929   |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 26 240 233   |
| EDP - Energias de Portugal                                | 25 396 426   |
| Etablissements Franz Colruyt NV                           | 23 632 761   |
| Fresenius Medical Care AG & Co KGaA                       | 21 756 453   |
| Allianz SE  | 19 783 266   |
| Koninklijke DSM NV  | 18 476 032   |
| Ageas SA/NV   | 18 084 746   |
| Ipsen SA  | 17 866 390   |
| Elia Group SA/NV  | 16 115 436   |
| UCB SA  | 13 717 221   |
| Merck KGaA  | 12 229 976   |
| L'Oreal SA  | 12 118 926   |
| Air Liquide SA  | 11 870 666   |
| Bouygues SA   | 11 515 493   |
| Software AG   | 10 651 740   |
| Enagas SA   | 10 046 959   |
| Glanbia PLC   | 9 438 260    |
| Henkel AG & Co KGaA                                       | 9 263 295    |
| Elisa Oyj   | 8 772 509    |
| Deutsche Post AG  | 8 464 502    |
| Wienerberger AG   | 8 451 843    |
| CRH PLC   | 8 380 700    |
| Gerresheimer AG   | 8 200 712    |
| Kone Oyj  | 7 360 111    |
| Koninklijke Vopak NV                                      | 7 255 974    |
| Solvay SA   | 7 172 877    |
| Huhtamaki Oyj   | 6 897 264    |
| FUCHS PETROLUB SE   | 6 849 635    |
| BASF SE   | 6 845 080    |
| Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA            | 6 757 090    |
| Buzzi Unicem SpA  | 6 633 434    |
| Rubis SCA   | 6 423 519    |
| ERG SpA   | 6 218 224    |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille                    | Coût USD   |
|---|------------|
| Paramount Global                          | 24 198 303 |
| JB Hi-Fi Ltd                              | 23 016 077 |
| Seagate Technology Holdings PLC           | 22 701 693 |
| A2A SpA                                   | 22 578 018 |
| Boston Properties                         | 22 461 242 |
| Highwoods Properties Inc                  | 21 113 895 |
| Newell Brands Inc                         | 20 877 934 |
| Walgreens Boots Alliance Inc              | 19 661 747 |
| Getty Realty Corp                         | 19 514 218 |
| Digital Realty Trust Inc                  | 19 449 368 |
| Intel Corp                                | 19 330 152 |
| Vanguard International Semiconductor Corp | 18 970 014 |
| Longfor Group Holdings Ltd                | 18 860 596 |
| Janus Henderson Group PLC                 | 18 773 301 |
| British American Tobacco PLC              | 18 473 583 |
| Adecco Group AG                           | 18 095 900 |
| HNI Corp                                  | 18 037 255 |
| Lenovo Group Ltd                          | 17 927 448 |
| LTC Properties Inc                        | 17 912 416 |
| 3M Co                                     | 17 668 150 |
| Best Buy Co Inc                           | 17 536 516 |
| Kennedy-Wilson Holdings Inc               | 17 275 063 |
| H&R Block Inc                             | 16 611 207 |
| Western Union Co                          | 16 458 315 |
| Verizon Communications Inc                | 16 366 150 |
| Hasbro Inc                                | 15 971 558 |
| South Jersey Industries Inc               | 14 734 926 |
| KeyCorp                                   | 14 549 084 |
| Universal Corp/VA                         | 14 346 351 |
| China Gas Holdings Ltd                    | 14 301 351 |
| Lixil Corp                                | 14 263 319 |
| Deutsche Post AG                          | 14 185 654 |
| Fidelity National Financial Inc           | 14 140 741 |
| Holcim AG                                 | 14 113 757 |
| Mitsui Mining & Smelting Co Ltd           | 14 083 746 |

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF (non audité) (suite)

| Ventes du Portefeuille               | Produits USD |
|--------------------------------------|--------------|
| H&R Block Inc                        | 50 278 756   |
| South Jersey Industries Inc          | 41 261 197   |
| Unum Group                           | 37 771 712   |
| Spire Inc                            | 28 361 403   |
| OGE Energy Corp                      | 27 075 348   |
| Enagas SA                            | 26 137 330   |
| NorthWestern Corp                    | 25 581 476   |
| AT&T Inc                             | 25 580 537   |
| Northwest Natural Holding Co         | 24 841 749   |
| Electric Power Development Co Ltd    | 24 139 196   |
| Amcors PLC                           | 24 033 806   |
| Arca Continental SAB de CV           | 23 866 460   |
| Rubis SCA                            | 22 946 029   |
| Intel Corp                           | 22 365 703   |
| Safety Insurance Group Inc           | 22 305 752   |
| Healthcare Services Group Inc        | 21 928 895   |
| Avista Corp                          | 21 898 888   |
| LTC Properties Inc                   | 21 644 890   |
| United Bankshares Inc/WV             | 21 470 456   |
| BAE Systems PLC                      | 21 300 701   |
| China Overseas Land & Investment     | 20 976 086   |
| FNB Corp/PA                          | 20 781 159   |
| Guangdong Investment Ltd             | 18 481 967   |
| Japan Metropolitan Fund Invest       | 17 737 270   |
| Brandywine Realty Trust              | 17 585 848   |
| Fukuoka Financial Group Inc          | 16 878 083   |
| Telenor ASA                          | 16 614 950   |
| Swisscom AG                          | 16 466 530   |
| B&G Foods Inc                        | 16 353 799   |
| Beijing Enterprises Holdings Ltd     | 15 683 135   |
| Ageas SA/NV                          | 15 640 936   |
| International Business Machines Corp | 15 055 653   |
| Pinnacle West Capital Corp           | 14 900 183   |
| Banque Cantonale Vaudoise            | 14 896 850   |
| Fresenius Medical Care AG & Co KGaA  | 14 834 055   |
| GSK PLC                              | 14 704 325   |
| Sulzer AG                            | 14 538 060   |
| EDP - Energias de Portugal           | 14 286 004   |
| Daiwa Office Investment Corp         | 13 872 599   |
| Ashmore Group PLC                    | 13 847 227   |
| Mercury General Corp                 | 13 452 803   |
| People's United Financial Inc        | 13 035 253   |
| Universal Corp/VA                    | 12 672 351   |
| KT&G Corp                            | 12 595 092   |
| Northwest Bancshares Inc             | 12 506 561   |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille                        | Coût USD  |
|---|-----------|
| Wistron Corp                                  | 5 076 867 |
| Longfor Group Holdings Ltd                    | 3 195 202 |
| Bosideng International Holdings Ltd           | 3 082 906 |
| CIFI Holdings Group Co Ltd                    | 1 913 035 |
| New China Life Insurance Co Ltd               | 1 843 017 |
| China Resources Gas Group Ltd                 | 1 565 861 |
| JB Hi-Fi Ltd                                  | 1 443 310 |
| Charter Hall Group                            | 1 432 379 |
| Hong Kong & China Gas Co Ltd                  | 1 424 230 |
| EBOS Group Ltd                                | 1 417 223 |
| ASPEED Technology Inc                         | 1 325 426 |
| LEENO Industrial Inc                          | 1 318 703 |
| Techtronic Industries Co Ltd                  | 1 261 146 |
| China Gas Holdings Ltd                        | 1 185 342 |
| Sonic Healthcare Ltd                          | 1 109 857 |
| New World Development Co Ltd                  | 993 252   |
| International Container Terminal Services Inc | 941 605   |
| APA Group CVS NPV                             | 933 135   |
| Altium Ltd                                    | 904 130   |
| CK Infrastructure Holdings Ltd                | 884 946   |
| Sinopharm Group Co Ltd                        | 880 197   |
| Henderson Land Development Co Ltd             | 828 893   |
| Nippon Gas Co Ltd                             | 818 000   |
| Swire Properties Ltd                          | 810 745   |
| Guangdong Investment Ltd                      | 808 951   |
| Link REIT                                     | 775 825   |
| China Resources Land Ltd                      | 767 372   |

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF (non audité) (suite)

| Ventes du Portefeuille                    | Produits USD |
|---|--------------|
| China Overseas Land & Investment          | 4 485 204    |
| New World Development Co Ltd              | 4 287 293    |
| Henderson Land Development Co Ltd         | 3 904 251    |
| Tripod Technology Corp                    | 3 746 563    |
| Ansell Ltd                                | 2 399 249    |
| CLP Holdings Ltd                          | 2 357 382    |
| Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd   | 2 241 289    |
| New China Life Insurance Co Ltd           | 1 943 192    |
| Sinopharm Group Co Ltd                    | 1 897 680    |
| Washington H Soul Pattinson & Co Ltd      | 1 816 084    |
| CIFI Holdings Group Co Ltd                | 1 812 842    |
| China Water Affairs Group Ltd             | 1 639 947    |
| APA Group CVS NPV                         | 1 612 482    |
| Hazama Ando Corp                          | 1 540 872    |
| Heiwa Real Estate REIT Inc                | 1 330 551    |
| NTT UD REIT Investment Corp               | 1 285 738    |
| Northern Star Resources Ltd               | 1 247 642    |
| China Resources Land Ltd                  | 1 217 873    |
| Daiwa Office Investment Corp              | 1 198 964    |
| Collins Foods Ltd                         | 1 154 840    |
| Aica Kogyo Co Ltd                         | 1 110 734    |
| Comforia Residential REIT Inc             | 917 785      |
| Nichias Corp                              | 910 023      |
| Shenzhou International Group Holdings Ltd | 890 508      |
| Denka Co Ltd                              | 876 414      |
| carsales.com Ltd                          | 849 437      |
| Nisshin Seifun Group Inc                  | 848 498      |
| Link REIT                                 | 797 045      |
| Chiba Bank Ltd                            | 767 691      |
| China Medical System Holdings Ltd         | 733 715      |
| Steadfast Group Ltd                       | 695 835      |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille          | Coût GBP  |
|---------------------------------|-----------|
| Intermediate Capital Group PLC  | 7 633 098 |
| Supermarket Income Reit PLC     | 7 016 147 |
| Hargreaves Lansdown PLC         | 6 696 311 |
| LondonMetric Property PLC       | 5 139 291 |
| Big Yellow Group PLC            | 5 062 978 |
| National Grid PLC               | 4 926 692 |
| Pets at Home Group Plc          | 4 381 720 |
| Pearson PLC                     | 4 361 017 |
| IG Group Holdings PLC           | 4 185 313 |
| Drax Group PLC                  | 3 889 538 |
| Derwent London PLC              | 3 509 440 |
| Safestore Holdings PLC          | 3 329 364 |
| Assura PLC                      | 3 183 801 |
| Primary Health Properties PLC   | 3 132 483 |
| Spectris PLC                    | 2 954 361 |
| Legal & General Group PLC       | 2 838 349 |
| Schroders PLC                   | 2 742 633 |
| Hikma Pharmaceuticals PLC       | 2 645 256 |
| British American Tobacco PLC    | 2 456 124 |
| Cranswick PLC                   | 2 431 796 |
| Unilever PLC                    | 2 023 209 |
| BAE Systems PLC                 | 1 632 887 |
| Sage Group PLC                  | 1 580 700 |
| Intertek Group PLC              | 1 492 211 |
| London Stock Exchange Group PLC | 1 293 653 |
| Spirax-Sarco Engineering PLC    | 1 265 751 |
| RS GROUP PLC                    | 1 207 667 |
| RELX PLC                        | 1 182 621 |
| Bunzl PLC                       | 1 170 298 |
| Diploma PLC                     | 1 131 500 |
| Smith & Nephew PLC              | 1 101 547 |
| Diageo PLC                      | 1 078 527 |
| Experian PLC                    | 1 071 579 |

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF (non audité) (suite)

| Ventes du Portefeuille         | Produits GBP |
|--------------------------------|--------------|
| Phoenix Group Holdings PLC     | 5 384 451    |
| Jupiter Fund Management PLC    | 4 884 501    |
| Admiral Group PLC              | 4 130 193    |
| HomeServe PLC                  | 4 120 355    |
| United Utilities Group PLC     | 3 957 617    |
| Ashmore Group PLC              | 3 818 800    |
| Tate & Lyle PLC                | 3 642 879    |
| IG Group Holdings PLC          | 3 555 721    |
| Moneysupermarket.com Group PLC | 3 518 028    |
| British American Tobacco PLC   | 2 327 867    |
| Legal & General Group PLC      | 2 147 936    |
| Hargreaves Lansdown PLC        | 1 878 455    |
| BAE Systems PLC                | 1 733 064    |
| Grainger PLC                   | 1 596 401    |
| AstraZeneca PLC                | 1 553 092    |
| Unilever PLC                   | 1 478 207    |
| Supermarket Income Reit PLC    | 1 455 917    |
| National Grid PLC              | 1 448 086    |
| Pearson PLC                    | 1 340 815    |
| Intermediate Capital Group PLC | 1 326 666    |
| Drax Group PLC                 | 1 320 506    |
| Sage Group PLC                 | 1 313 812    |
| Schroders PLC                  | 1 266 856    |
| Diageo PLC                     | 1 230 986    |
| Primary Health Properties PLC  | 1 223 322    |
| Assura PLC                     | 1 133 935    |
| Spectris PLC                   | 1 013 344    |
| Bunzl PLC                      | 972 548      |
| Big Yellow Group PLC           | 944 408      |
| Hikma Pharmaceuticals PLC      | 922 867      |
| LondonMetric Property PLC      | 889 580      |
| Cranswick PLC                  | 886 442      |
| Smith & Nephew PLC             | 859 123      |
| RELX PLC                       | 825 174      |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF (non audité)

| Achats du Portefeuille                 | Coût USD    |
|--|-------------|
| VF Corp                                | 133 700 724 |
| Walgreens Boots Alliance Inc           | 78 692 058  |
| Stanley Black & Decker Inc             | 73 478 762  |
| 3M Co                                  | 73 356 379  |
| T Rowe Price Group Inc                 | 66 548 331  |
| UGI Corp                               | 65 892 474  |
| Avista Corp                            | 65 785 899  |
| Essex Property Trust Inc               | 64 902 157  |
| ONE Gas Inc                            | 63 576 792  |
| Franklin Resources Inc                 | 62 166 985  |
| Flowers Foods Inc                      | 59 518 610  |
| Nu Skin Enterprises Inc                | 58 217 869  |
| International Flavors & Fragrances Inc | 58 147 204  |
| Leggett & Platt Inc                    | 55 619 178  |
| Federal Realty Investment Trust        | 54 376 292  |
| Realty Income                          | 49 628 421  |
| Target                                 | 49 417 327  |
| Kimberly-Clark Corp                    | 47 958 994  |
| Medtronic PLC                          | 47 840 777  |
| Lockheed Martin Corp                   | 47 454 426  |
| National Retail Properties Inc         | 47 034 474  |
| Amcor PLC                              | 44 562 064  |
| Clorox Co                              | 43 780 231  |
| United Bankshares Inc/WV               | 43 275 594  |
| New Jersey Resources Corp              | 41 791 656  |
| International Business Machines Corp   | 40 584 881  |
| Bank OZK                               | 38 909 990  |



## Annexe II – Tableau des mouvements importants du Portefeuille (non audité) (suite)

### Tableau des mouvements importants du portefeuille du Compartiment SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF (non audité) (suite)

| Ventes du Portefeuille               | Produits USD |
|--------------------------------------|--------------|
| VF Corp                              | 116 376 685  |
| Exxon Mobil Corp                     | 103 918 525  |
| South Jersey Industries Inc          | 102 591 428  |
| Chevron Corp                         | 75 733 404   |
| Cardinal Health Inc                  | 66 376 353   |
| People's United Financial Inc        | 65 456 079   |
| Telephone and Data Systems Inc       | 55 187 679   |
| UGI Corp                             | 45 897 858   |
| Nucor Corp                           | 45 136 390   |
| Franklin Resources Inc               | 42 955 956   |
| International Business Machines Corp | 40 462 988   |
| Caterpillar Inc                      | 39 592 767   |
| National Retail Properties Inc       | 38 488 107   |
| Consolidated Edison Inc              | 38 309 923   |
| Genuine Parts Co                     | 37 845 945   |
| AbbVie Inc                           | 36 986 123   |
| Archer-Daniels-Midland Co            | 36 786 594   |
| Leggett & Platt Inc                  | 36 447 490   |
| Aflac Inc                            | 35 055 954   |
| Kimberly-Clark Corp                  | 34 947 307   |
| Lancaster Colony Corp                | 34 697 564   |
| Amcor PLC                            | 34 497 275   |
| Air Products and Chemicals Inc       | 34 088 075   |
| Realty Income                        | 31 907 565   |
| MDU Resources Group Inc              | 27 636 097   |
| United Bankshares Inc/WV             | 26 747 908   |
| Southern Co                          | 26 626 703   |
| Embecka Corp                         | 26 417 254   |

Une copie de la liste des mouvements importants du portefeuille survenus pendant l'exercice financier peut être obtenue sur simple demande auprès de l'Agent administratif.

## Annexe III – Informations à fournir en vertu des Règlements SFDR et taxinomie (non auditées)

Le nouveau Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (*Sustainable Finance Disclosure Regulation*, « SFDR ») a introduit diverses exigences en matière de publication d'informations pour les acteurs du marché financier et les conseillers financiers sur le plan des entités, des services et des produits. Il vise à fournir une plus grande transparence sur la durabilité au sein des marchés financiers de manière standardisée, prévenant ainsi l'écoblanchiment et assurant la comparabilité. Le Prospectus et les Suppléments mis à jour ont été approuvés par la BCI en date du 9 mars 2021 afin de refléter les changements requis concernant le SFDR. Le 22 octobre 2021, les Autorités européennes de surveillance (« AES ») ont publié conjointement un rapport final avec des normes techniques de réglementation (« NTR ») au titre du SFDR en ce qui concerne les divulgations liées à la taxinomie, y compris une ébauche consolidée de NTR en ce qui concerne le SFDR et la taxinomie. La date d'application de cette ébauche de NTR est prévue pour le 1<sup>er</sup> juillet 2022. Les obligations d'information en vertu du règlement sur la taxinomie au niveau des produits de Niveau 1 sont exigées depuis le 1<sup>er</sup> janvier 2022 et sont reflétées dans le prospectus de la Société.

### Compartiments relevant des produits financiers de l'Article 6 du SFDR

Les investissements sous-jacents à chacun des Compartiments figurant dans le tableau ci-dessous ne tiennent pas compte des critères de l'UE concernant des activités économiques durables sur le plan environnemental.

SPDR Bloomberg 0-3 Year Euro Corporate Bond UCITS ETF  
SPDR Bloomberg 0-3 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF  
SPDR Bloomberg 1-3 Month T-Bill UCITS ETF  
SPDR Bloomberg 1-3 Year Euro Government Bond UCITS ETF  
SPDR Bloomberg 1-3 Year U.S. Treasury Bond UCITS ETF  
SPDR Bloomberg 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF  
SPDR Bloomberg Emerging Markets Local Bond UCITS ETF  
SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF  
SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF  
SPDR Bloomberg Euro High Yield Bond UCITS ETF  
SPDR Bloomberg Global Aggregate Bond UCITS ETF  
SPDR Bloomberg U.S. TIPS UCITS ETF  
SPDR Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF  
SPDR Bloomberg China Treasury Bond UCITS ETF  
SPDR Dow Jones Global Real Estate UCITS ETF  
SPDR FTSE EPRA Europe Ex UK Real Estate UCITS ETF  
SPDR FTSE U.K. All Share UCITS ETF  
SPDR MSCI ACWI UCITS ETF  
SPDR MSCI EM Asia UCITS ETF  
SPDR MSCI EMU UCITS ETF

SPDR MSCI Japan UCITS ETF  
SPDR MSCI World UCITS ETF  
SPDR S&P 400 U.S. Mid Cap UCITS ETF  
SPDR S&P 500 UCITS ETF  
SPDR S&P 500 Low Volatility UCITS ETF  
SPDR S&P Emerging Markets Dividend Aristocrats UCITS ETF  
SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF  
SPDR S&P Global Dividend Aristocrats UCITS ETF  
SPDR S&P Pan Asia Dividend Aristocrats UCITS ETF  
SPDR S&P U.K. Dividend Aristocrats UCITS ETF  
SPDR S&P U.S. Dividend Aristocrats UCITS ETF

### Compartiments relevant des produits financiers de l'Article 8 du SFDR

Les Compartiments inclus dans le tableau ci-dessous respectent les exigences de l'Article 8 du SFDR du fait qu'ils promeuvent, entre autres, des caractéristiques environnementales ou sociales, ou une combinaison de ces caractéristiques, et que les sociétés en portefeuille font preuve de bonne gouvernance.

SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF  
SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF  
SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF  
SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF

**Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852**

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne dresse pas de liste d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

**Dénomination du produit :** SPDR Bloomberg SASB Euro Corporate ESG UCITS ETF (le « Compartiment »)

**Identifiant d'entité juridique :** 549300217DO1QDEDXS09

## Caractéristiques environnementales et/ou sociales

### Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

**Oui**

**Non**

Il a réalisé **des investissements durables ayant un objectif environnemental** : \_\_\_\_ %

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé **des investissements durables ayant un objectif social** : \_\_\_\_ %

Il a promu des **caractéristiques environnementales et sociales (E/S)** et, bien que son objectif ne portait pas sur l'investissement durable, il a présenté une proportion de \_\_\_\_ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il a promu des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**



Les indicateurs de durabilité évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

## Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment promeut les facteurs environnementaux et sociaux qui participent aux scores R-Factor™ appliqués aux composantes de l'indice, notamment celles de l'indice Bloomberg SASB Euro Corporate ESG Ex-Controversies Select Index (l'« Indice »), lesquels sont fonction de l'évaluation et de la notation établies par le fournisseur de l'Indice sur diverses caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance pour les entreprises comprises dans l'univers de l'Indice.

Pour plus d'informations sur les scores R-Factor™, veuillez vous reporter au site Internet de SSGA :

[https://www.ssga.com/uk/en\\_gb/intermediary/ic/capabilities/esg/data-scoring/r-factor-transparent-esg-scoring#:~:text=R%2DFactor%E2%84%A2%20is%20the,materiality%20in%20the%20scoring%20process.](https://www.ssga.com/uk/en_gb/intermediary/ic/capabilities/esg/data-scoring/r-factor-transparent-esg-scoring#:~:text=R%2DFactor%E2%84%A2%20is%20the,materiality%20in%20the%20scoring%20process.)

En outre, l'Indice exclut les émetteurs associés à des controverses sur événements extrêmes, aux armes controversées, aux violations des principes du Pacte mondial des Nations unies (« PMNU »), aux armes à feu civiles, à l'extraction de charbon thermique et à l'industrie du tabac.

Le Compartiment vise à répliquer l'Indice avec une possible variation annuelle à hauteur de 1 % dans des conditions de marché normales. L'écart de suivi sur un an au 31 mars 2023 ressort à 0,08 %. L'acrt de suivi du Compartiment est conforme aux prévisions.

### ● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité, utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce Compartiment, sont basés sur l'Indice, lequel optimise une notation ESG formée/constituée par un « facteur de responsabilité » (« R-Factor™ »). Le R-Factor aborde la cotation ESG en exploitant le spectre intégral des éléments de mesure « financièrement significatifs » pour isoler les facteurs de durabilité à long terme d'importance dans l'ensemble des dimensions que sont l'environnement, le capital humain, le capital social, le modèle économique, le leadership et la gouvernance d'entreprise.

La méthodologie d'attribution des scores intègre systématiquement les meilleures données (« best-in-class »), un cadre de durabilité transparent, l'importance relative des différents secteurs d'activité sur le plan financier et des normes de gouvernance d'entreprise et ce, afin de définir un score R-Factor pour chaque entreprise.

### ● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

N/A – première période de référence. Pas d'élément de comparaison disponible.

### ● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement sur la taxinomie.

### ● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

— *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

S/O

— *Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :*

S/O

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

*La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.*

*Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.*

*Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.*



### **Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?**

Le Compartiment visait à réduire les externalités négatives causées par les investissements sous-jacents et a, dans ce contexte, examiné les Principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de durabilité en appliquant des filtres ESG basés sur des normes au sein de l'indice. Plus précisément, l'Indice a pris en considération :

- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition à des armes controversées

De plus amples informations sur les PIN sont consultables dans les Rapports périodiques du Compartiment.



**Quel s ont été les principaux investissements de ce produit financier ?**

| <b>Investissements les plus importants</b> | <b>Secteur</b>             | <b>% d'actifs</b> | <b>Pays</b> |
|--|----------------------------|-------------------|-------------|
| BNP PARIBAS                                | ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS  | 3,26              | FRANCE      |
| UNIBAIL RODAMCO WESTFLD                    | ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS  | 2,58              | FRANCE      |
| STELLANTIS NV                              | INDUSTRIE                  | 2,57              | PAYS-BAS    |
| DIAGEO FINANCE PLC                         | INDUSTRIE                  | 2,55              | ROYAUME-UNI |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT SA                    | SERVICES AUX COLLECTIVITÉS | 2,46              | FRANCE      |
| DANONE SA                                  | INDUSTRIE                  | 2,43              | FRANCE      |
| AXA SA                                     | ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS  | 2,40              | FRANCE      |
| CNP ASSURANCES                             | ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS  | 2,22              | FRANCE      |
| SAP SE                                     | INDUSTRIE                  | 2,15              | ALLEMAGNE   |
| GECINA                                     | ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS  | 2,03              | FRANCE      |
| INTESA SANPAOLO SPA                        | ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS  | 1,92              | ITALIE      |
| KLEPIERRE SA                               | ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS  | 1,65              | FRANCE      |
| ICADE                                      | ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS  | 1,63              | FRANCE      |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE                      | INDUSTRIE                  | 1,61              | FRANCE      |
| COVIVIO                                    | ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS  | 1,59              | FRANCE      |



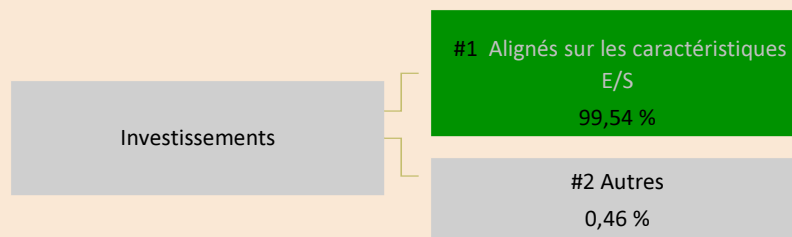
**L'allocation des actifs** décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

## Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-après – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

### ● Quelle était l'allocation des actifs ?

99,54 % des actifs du Fonds ont été investis en titres classés sous la catégorie « #1 Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales » comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 0,46 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie « #2 Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie « **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** » comprend :

- la sous-catégorie « **#1A Durables** » couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie « **#1B Autres caractéristiques E/S** » couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives en matière de sécurité et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions

### ● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

| Secteur / Sous-secteur          | % d'allocation |
|---------------------------------|----------------|
| <b>INDUSTRIE</b>                | <b>52,58</b>   |
| SECTEURS DE BASE                | 3,22           |
| BIENS D'ÉQUIPEMENT              | 5,43           |
| COMMUNICATIONS                  | 4,64           |
| BIENS DE CONSOMMATION CYCLIQUES | 9,23           |

de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

|   |              |
|---|--------------|
| BIENS DE CONSOMMATION NON CYCLIQUES             | 19,57        |
| ÉNERGIE   | 2,83         |
| TECHNOLOGIE                                     | 6,74         |
| TRANSPORT                                       | 0,92         |
| <b>ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS</b>                | <b>42,99</b> |
| BANQUES   | 19,52        |
| COURTAGE – GESTION D'ACTIFS – BOURSES DE VALEUR | 0,11         |
| FINANCE – AUTRES                                | 2,34         |
| ASSURANCE                                       | 9,55         |
| FONDS DE PLACEMENT IMMOBILIER (REIT)            | 11,47        |
| <b>SERVICES AUX COLLECTIVITÉS</b>               | <b>8,56</b>  |
| FOURNISSEURS D'ÉLECTRICITÉ                      | 3,42         |
| FOURNISSEURS DE GAZ NATUREL                     | 2,69         |
| AUTRES SERVICES AUX COLLECTIVITÉS               | 2,46         |
| <b>ÉQUIVALENTS DE TRÉSORERIE</b>                | <b>0,46</b>  |



**Dans quelle mesure minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour l'heure, le Compartiment ne s'est pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du Règlement taxinomie.

- **Le produit financier investissait-il dans des activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE<sup>1</sup> ?**

Oui :

Dans le gaz  
fossile

Dans l'énergie nucléaire

**Non**

<sup>1</sup> Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.



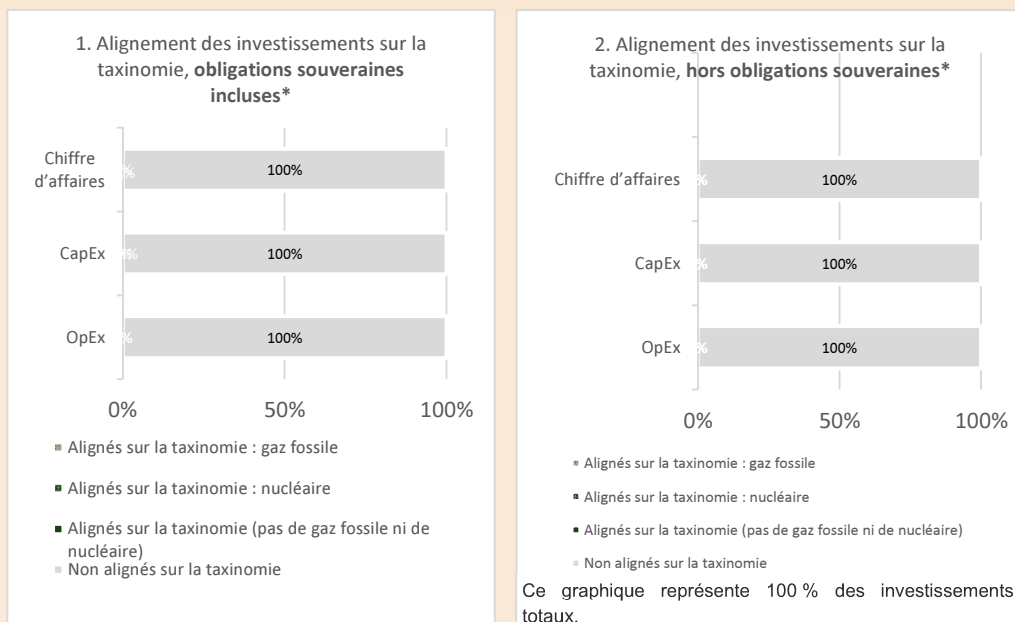
Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;

- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple.

- **dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

**Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines\* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.**



\* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

**Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du Règlement taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

**Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

N/A – première période de référence. Pas d'élément de comparaison disponible.

**Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE.

**Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?**

S/O

Le symbole  représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement UE 2020/852.



### **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?**

Le Compartiment détenait 0,46 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire d'investissement, classés sous la catégorie « #2 Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



### **Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Compartiment réplique le plus fidèlement possible la performance de l'Indice (ou de tout autre indice déterminé par les Administrateurs le cas échéant pour répliquer substantiellement le même marché que l'Indice), tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart entre sa performance et celle de l'Indice.

La politique d'investissement du Compartiment consiste à reproduire la performance de l'Indice. Le Compartiment investit au moins 90 % de ses actifs dans des titres qui composent l'Indice, tandis que le Fournisseur d'indice applique des notations ESG à toutes les composantes de l'Indice.

Le Compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales via l'utilisation de filtres qui visent à exclure les titres liés à certains secteurs, certaines entreprises ou pratiques, sur la base de critères ESG spécifiques, et l'adoption d'une approche « best-in-class » sur la base de la performance ESG en comparaison des univers d'investissement et/ou des homologues du secteur lorsqu'ils sont évalués selon des critères objectifs au sein de l'Indice.

La méthodologie de l'Indice prévoit une révision et un rééquilibrage mensuels.

Les sociétés que le Fournisseur d'indice juge ne pas contrevenir aux principes du PMNU sont réputées faire preuve de bonne gouvernance. Pour toutes informations sur les méthodologies utilisées dans la construction de l'Indice et davantage de renseignements sur les critères d'exclusion et les sources de données, veuillez vous référer au descriptif concernant la méthodologie indiciaire de l'indice Bloomberg qui peut être consulté sur le lien suivant :

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>



### **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence durable ?**

L'objectif du Compartiment consiste à fournir aux investisseurs un rendement total, en tenant compte à la fois des rendements de capital et des revenus, qui reflète généralement le rendement de l'Indice.

La politique d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'Indice aussi étroitement que possible, tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice de 12 mois clôturé au 31 mars 2023, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a enregistré une performance de -7,64 % sur une base brute de commissions, sous-performant son indice de référence, dont le rendement est ressorti à -7,50 %, de 14 points de base (pb). Le Compartiment a généré une performance de -7,77 % sur une base nette de

commissions au cours de la Période considérée.

Pour toutes informations sur les méthodologies utilisées dans la construction de l'Indice et davantage de renseignements sur les critères d'exclusion et les sources de données, veuillez vous référer au

descriptif concernant la méthodologie indiciaire de Bloomberg, consultable sur le lien suivant :

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

● **En quoi l'indice de référence diffèrerait-il d'un indice de marché large ?**

L'Indice repose sur l'indice Bloomberg Euro Corporate Bond Index, son indice parent, qui représente la performance de marché des obligations d'entreprise, à taux fixe, de qualité *investment grade* et libellées en euros.

L'indice de référence du Compartiment (à savoir, l'indice Bloomberg SASB Euro Corporate ESG Ex-Controversies Select Index) est un indice de qualité *investment grade*, à taux fixe et libellé en euros visant à optimiser le score R-Factor™, une notation reflétant le respect des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance (« ESG ») fournie par Street Global Advisors®. L'Indice sélectionne des titres éligibles à l'indice Euro Corporate Index, puis vise à exclure certains émetteurs en fonction de leurs caractéristiques ESG, compte tenu de leur score ESG et de leur implication dans certaines activités controversées, comme indiqué dans la méthodologie de l'Indice.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

La méthodologie de l'Indice prévoit une révision et un rééquilibrage mensuels.

La politique d'investissement du Compartiment consiste à reproduire la performance de l'Indice. Le Compartiment investit au moins 90 % de ses actifs dans des titres qui composent l'Indice, tandis que le Fournisseur d'indice applique des notations ESG à toutes les composantes de l'Indice.

Le Compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales via l'utilisation de filtres qui visent à exclure les titres liés à certains secteurs, certaines entreprises ou pratiques, sur la base de critères ESG spécifiques, et l'adoption d'une approche « best-in-class » sur la base de la performance ESG en comparaison des univers d'investissement et/ou des homologues du secteur lorsqu'ils sont évalués selon des critères objectifs au sein de l'Indice.

En outre, l'Indice exclut les émetteurs associés à des controverses sur événements extrêmes, aux armes controversées, aux violations des principes du Pacte mondial des Nations unies (« PMNU »), aux armes à feu civiles, à l'extraction de charbon thermique et à l'industrie du tabac.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Le Compartiment a enregistré une performance de -7,64 % sur une base brute de commissions, sous-performant l'indice de marché large, dont le rendement est ressorti à -7,55 %, de 9 points de base. Le Compartiment a généré une performance de -7,77 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. La politique d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'Indice aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice. Il n'est pas prévu que le Compartiment réplique l'indice de marché large.

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

**Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852**

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne dresse pas de liste d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

**Dénomination du produit :** SPDR Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF (le « Compartiment »)

**Identifiant d'entité juridique :**  
549300D9O5F5P2DTYB19

## Caractéristiques environnementales et/ou sociales

### Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

✓ **Oui**

☒ **Non**

Il a réalisé **des investissements durables ayant un objectif environnemental** : \_\_\_\_ %

- dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
- dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé **des investissements durables ayant un objectif social** : \_\_\_\_ %

Il a promu des **caractéristiques environnementales et sociales (E/S)** et, bien que son objectif ne portait pas sur l'investissement durable, il a présenté une proportion de \_\_\_\_ % d'investissements durables

- ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
- ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
- ayant un objectif social

Il a promu des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**



Les indicateurs de durabilité évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

## Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment promeut les facteurs environnementaux et sociaux qui participent aux scores R-Factor™ appliqués aux composantes de l'indice, notamment celles de l'indice Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG Ex-Controversies Select Index (l'« Indice »), lesquels sont fonction de l'évaluation et de la notation établies par le fournisseur de l'Indice sur diverses caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance pour les entreprises comprises dans l'univers de l'Indice.

Pour plus d'informations sur les scores R-Factor™, veuillez vous reporter au site Internet de SSGA :

[https://www.ssga.com/uk/en\\_gb/intermediary/ic/capabilities/esg/data-scoring/r-factor-transparent-esg-scoring#:~:text=R%2DFactor%E2%84%A2%20is%20the,materiality%20in%20the%20scoring%20process](https://www.ssga.com/uk/en_gb/intermediary/ic/capabilities/esg/data-scoring/r-factor-transparent-esg-scoring#:~:text=R%2DFactor%E2%84%A2%20is%20the,materiality%20in%20the%20scoring%20process).

En outre, l'Indice exclut les émetteurs associés à des controverses sur événements extrêmes, aux armes controversées, aux violations des principes du Pacte mondial des Nations unies (« PMNU »), aux armes à feu civiles, à l'extraction de charbon thermique et à l'industrie du tabac.

Le Compartiment vise à répliquer l'Indice avec une possible variation annuelle à hauteur de 1 % dans des conditions de marché normales. L'écart de suivi sur un an au 31 mars 2023 ressort à 0,07 %. L'acta de suivi du Compartiment est conforme aux prévisions.

### ● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité, utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce Compartiment, sont basés sur l'Indice, lequel optimise une notation ESG formée/constituée par un « facteur de responsabilité » (« R-Factor™ »). Le R-Factor aborde la cotation ESG en exploitant le spectre intégral des éléments de mesure « financièrement significatifs » pour isoler les facteurs de durabilité à long terme d'importance dans l'ensemble des dimensions que sont l'environnement, le capital humain, le capital social, le modèle économique, le leadership et la gouvernance d'entreprise.

La méthodologie d'attribution des scores intègre systématiquement les meilleures données (« best-in-class »), un cadre de durabilité transparent, l'importance relative des différents secteurs d'activité sur le plan financier et des normes de gouvernance d'entreprise et ce, afin de définir un score R-Factor pour chaque entreprise.

### ● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

N/A – première période de référence. Pas d'élément de comparaison disponible.

### ● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement sur la taxinomie.

### ● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

— *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

S/O

— *Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :*

S/O

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

*La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.*

*Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.*

*Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.*

### **Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?**



Le Compartiment visait à réduire les externalités négatives causées par les investissements sous-jacents et a, dans ce contexte, examiné les Principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de durabilité en appliquant des filtres ESG basés sur des normes au sein de l'indice. Plus précisément, l'Indice a pris en considération :

- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition à des armes controversées

De plus amples informations sur les PIN sont consultables dans les Rapports périodiques du Compartiment.



**Quel s ont été les principaux investissements de ce produit financier ?**

| <b>Investissements les plus importants</b> | <b>Secteur</b>            | <b>% d'actifs</b> | <b>Pays</b>      |
|--|---------------------------|-------------------|------------------|
| JPMORGAN CHASE + CO                        | ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS | 4,12              | ÉTATS-UNIS (LES) |
| APPLE INC                                  | INDUSTRIE                 | 2,97              | ÉTATS-UNIS (LES) |
| MORGAN STANLEY                             | ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS | 2,61              | ÉTATS-UNIS (LES) |
| HP INC                                     | INDUSTRIE                 | 2,16              | ÉTATS-UNIS (LES) |
| AT+T INC                                   | INDUSTRIE                 | 2,15              | ÉTATS-UNIS (LES) |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC                   | ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS | 2,14              | ROYAUME-UNI      |
| BANK OF MONTREAL                           | ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS | 2,11              | CANADA           |
| BOSTON PROPERTIES LP                       | ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS | 2,07              | ÉTATS-UNIS (LES) |
| CISCO SYSTEMS INC                          | INDUSTRIE                 | 2,04              | ÉTATS-UNIS (LES) |
| NOVARTIS CAPITAL CORP                      | INDUSTRIE                 | 1,97              | ÉTATS-UNIS (LES) |
| VERIZON COMMUNICATIONS                     | INDUSTRIE                 | 1,97              | ÉTATS-UNIS (LES) |
| DIAGEO CAPITAL PLC                         | INDUSTRIE                 | 1,94              | ROYAUME-UNI      |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC                    | ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS | 1,87              | ÉTATS-UNIS (LES) |
| CITIGROUP INC                              | ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS | 1,78              | ÉTATS-UNIS (LES) |
| INTEL CORP                                 | INDUSTRIE                 | 1,70              | ÉTATS-UNIS (LES) |





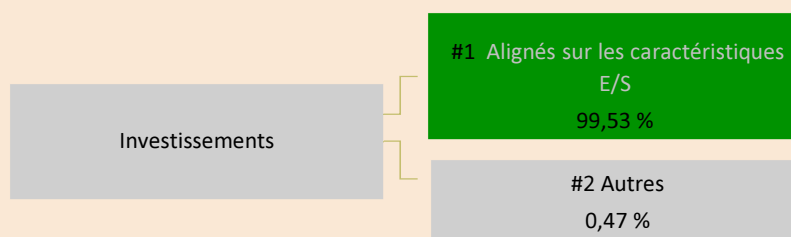
**L'allocation des actifs** décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

## Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-après – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

### ● Quelle était l'allocation des actifs ?

99,53 % des actifs du Fonds ont été investis en titres classés sous la catégorie « #1 Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales » comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 0,47 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie « #2 Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives en matière de sécurité et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie « **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** » comprend :

- la sous-catégorie « **#1A Durables** » couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie « **#1B Autres caractéristiques E/S** » couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

### ● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

| Secteur / Sous-secteur | % d'allocation |
|------------------------|----------------|
| <b>INDUSTRIE</b>       | <b>61,98</b>   |
| SECTEURS DE BASE       | 3,45           |
| BIENS D'ÉQUIPEMENT     | 3,92           |
| COMMUNICATIONS         | 9,88           |



de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

|   |              |
|---|--------------|
| BIENS DE CONSOMMATION CYCLIQUES                 | 4,78         |
| BIENS DE CONSOMMATION NON CYCLIQUES             | 18,48        |
| ÉNERGIE   | 3,50         |
| TECHNOLOGIE                                     | 17,38        |
| TRANSPORT                                       | 0,58         |
| <b>ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS</b>                | <b>33,55</b> |
| BANQUES   | 24,27        |
| COURTAGE – GESTION D'ACTIFS – BOURSES DE VALEUR | 0,44         |
| SOCIÉTÉS FINANCIÈRES                            | 0,01         |
| ASSURANCE                                       | 1,39         |
| FONDS DE PLACEMENT IMMOBILIER (REIT)            | 7,45         |
| <b>SERVICES AUX COLLECTIVITÉS</b>               | <b>5,91</b>  |
| FOURNISSEURS D'ÉLECTRICITÉ                      | 5,31         |
| FOURNISSEURS DE GAZ NATUREL                     | 0,58         |
| AUTRES SERVICES AUX COLLECTIVITÉS               | 0,02         |
| <b>ÉQUIVALENTS DE TRÉSORERIE</b>                | <b>0,47</b>  |



**Dans quelle mesure minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Pour l'heure, le Compartiment ne s'est pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du Règlement taxinomie.

- **Le produit financier investissait-il dans des activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE<sup>1</sup> ?**

**Oui :**

Dans le gaz fossile  Dans l'énergie nucléaire

**Non**

<sup>1</sup> Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

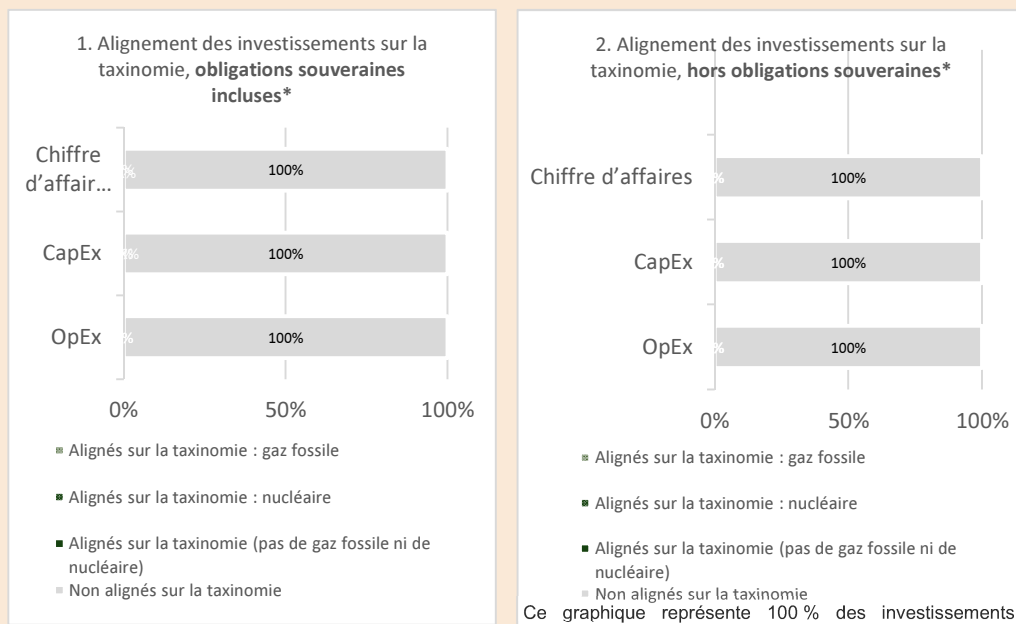
Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;

- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple.

- **dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

**Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines\* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.**



\* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

**Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du Règlement taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

**Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

N/A – première période de référence. Pas d'élément de comparaison disponible.

**Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE.

**Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?**

S/O



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement UE 2020/852.





### **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?**

Le Compartiment détenait 0,47 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire d'investissement, classés sous la catégorie « #2 Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



### **Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Compartiment réplique le plus fidèlement possible la performance de l'Indice (ou de tout autre indice déterminé par les Administrateurs le cas échéant pour répliquer substantiellement le même marché que l'Indice), tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart entre sa performance et celle de l'Indice.

La politique d'investissement du Compartiment consiste à reproduire la performance de l'Indice. Le Compartiment investit au moins 90 % de ses actifs dans des titres qui composent l'Indice, tandis que le Fournisseur d'indice applique des notations ESG à toutes les composantes de l'Indice.

Le Compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales via l'utilisation de filtres qui visent à exclure les titres liés à certains secteurs, certaines entreprises ou pratiques, sur la base de critères ESG spécifiques, et l'adoption d'une approche « best-in-class » sur la base de la performance ESG en comparaison des univers d'investissement et/ou des homologues du secteur lorsqu'ils sont évalués selon des critères objectifs au sein de l'Indice.

La méthodologie de l'Indice prévoit une révision et un rééquilibrage mensuels.

Les sociétés que le Fournisseur d'indice juge ne pas contrevenir aux principes du PMNU sont réputées faire preuve de bonne gouvernance. Pour toutes informations sur les méthodologies utilisées dans la construction de l'Indice et davantage de renseignements sur les critères d'exclusion et les sources de données, veuillez vous référer au descriptif concernant la méthodologie indiciaire de l'indice Bloomberg qui peut être consulté sur le lien suivant :

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>



### **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence durable ?**

L'objectif du Compartiment consiste à fournir aux investisseurs un rendement total, en tenant compte à la fois des rendements de capital et des revenus, qui reflète généralement le rendement de l'Indice.

La politique d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'Indice aussi étroitement que possible, tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice de 12 mois clôturé au 31 mars 2023, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a enregistré une performance de -5,81 % sur une base brute de commissions, sous-performant son indice de référence, dont le rendement est ressorti à -5,72 %, de 9 points de base (pb). Le Compartiment a généré une performance de -5,95 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée.

Pour toutes informations sur les méthodologies utilisées dans la construction de l'Indice et davantage de renseignements sur les critères d'exclusion et les sources de données, veuillez vous référer au

descriptif concernant la méthodologie indicielle de Bloomberg, consultable sur le lien suivant :

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

● **En quoi l'indice de référence différerait-il d'un indice de marché large ?**

L'Indice repose sur l'indice Bloomberg U.S. Corporate Bond Index, son indice parent, qui représente la performance de marché des obligations d'entreprise, à taux fixe, de qualité *investment grade* et libellées en dollars américains.

L'indice de référence du Compartiment (à savoir, l'indice Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG Ex-Controversies Select Index) est un indice de qualité *investment grade*, à taux fixe et libellé en dollars américains visant à optimiser le score R-Factor™, une notation reflétant le respect des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance (« ESG ») fournie par Street Global Advisors®. L'Indice sélectionne des titres éligibles à l'indice U.S. Corporate Index, puis vise à exclure certains émetteurs en fonction de leurs caractéristiques ESG, compte tenu de leur score ESG et de leur implication dans certaines activités controversées, comme indiqué dans la méthodologie de l'Indice.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

La méthodologie de l'Indice prévoit une révision et un rééquilibrage mensuels.

La politique d'investissement du Compartiment consiste à reproduire la performance de l'Indice. Le Compartiment investit au moins 90 % de ses actifs dans des titres qui composent l'Indice, tandis que le Fournisseur d'indice applique des notations ESG à toutes les composantes de l'Indice.

Le Compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales via l'utilisation de filtres qui visent à exclure les titres liés à certains secteurs, certaines entreprises ou pratiques, sur la base de critères ESG spécifiques, et l'adoption d'une approche « best-in-class » sur la base de la performance ESG en comparaison des univers d'investissement et/ou des homologues du secteur lorsqu'ils sont évalués selon des critères objectifs au sein de l'Indice.

En outre, l'Indice exclut les émetteurs associés à des controverses sur événements extrêmes, aux armes controversées, aux violations des principes du Pacte mondial des Nations unies (« PMNU »), aux armes à feu civiles, à l'extraction de charbon thermique et à l'industrie du tabac.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Le Compartiment a enregistré une performance de -5,81 % sur une base brute de commissions, sous-performant l'indice de marché large, dont le rendement est ressorti à -0,04 %, de 577 points de base. Le Compartiment a généré une performance de -5,95 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. La politique d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'Indice aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice. Il n'est pas prévu que le Compartiment réplique l'indice de marché large.

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

**Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2a bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852**

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne dresse pas de liste d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

**Dénomination du produit :** SPDR Bloomberg SASB U.S. High Yield ESG UCITS ETF (le « Compartiment »)

**Identifiant d'entité juridique :**  
549300TT5VW373IGI142

## Caractéristiques environnementales et/ou sociales

### Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

|  |  |   |   |
|--|--|---|---|
| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> | <b>Oui</b>   | <input type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> | <b>Non</b>  |
| <input type="checkbox"/>   | Il a réalisé <b>des investissements durables ayant un objectif environnemental</b> : ____ %  | <input type="checkbox"/>  | Il a promu des <b>caractéristiques environnementales et sociales (E/S)</b> et, bien que son objectif ne portait pas sur l'investissement durable, il a présenté une proportion de ____ % d'investissements durables |
| <input type="checkbox"/>   | dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE        | <input type="checkbox"/>  | ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE   |
| <input type="checkbox"/>   | dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE | <input type="checkbox"/>  | ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE  |
| <input type="checkbox"/>   | Il a réalisé <b>des investissements durables ayant un objectif social</b> : ____ %   | <input checked="" type="checkbox"/>   | Il a promu des caractéristiques E/S, mais <b>n'a pas réalisé d'investissements durables</b>   |



Les indicateurs de durabilité évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

## Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment promeut les facteurs environnementaux et sociaux qui participent aux scores R-Factor™ appliqués aux composantes de l'indice, notamment celles de l'indice Bloomberg SASB US Corporate High Yield ESG Ex-Controversies Select Index (l'« Indice »), lesquels sont fonction de l'évaluation et de la notation établies par le fournisseur de l'Indice sur diverses caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance pour les entreprises comprises dans l'univers de l'Indice.

Pour plus d'informations sur les scores R-Factor™, veuillez vous reporter au site Internet de SSGA :

[https://www.ssga.com/uk/en\\_gb/intermediary/ic/capabilities/esg/data-scoring/r-factor-transparent-esg-scoring#:~:text=R%2DFactor%E2%84%A2%20is%20the,materiality%20in%20the%20scoring%20process](https://www.ssga.com/uk/en_gb/intermediary/ic/capabilities/esg/data-scoring/r-factor-transparent-esg-scoring#:~:text=R%2DFactor%E2%84%A2%20is%20the,materiality%20in%20the%20scoring%20process).

En outre, l'Indice exclut les émetteurs associés à des controverses sur événements extrêmes, aux armes controversées, aux violations des principes du Pacte mondial des Nations unies (« PMNU »), aux armes à feu civiles, à l'extraction de charbon thermique et à l'industrie du tabac.

Le Compartiment vise à répliquer l'Indice avec une possible variation annuelle à hauteur de 2 % dans des conditions de marché normales. L'écart de suivi sur un an au 31 mars 2023 ressort à 0,32 %. L'acta de suivi du Compartiment est conforme aux prévisions.

### ● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité, utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce Compartiment, sont basés sur l'Indice, lequel optimise une notation ESG formée/constituée par un « facteur de responsabilité » (« R-Factor™ »). Le R-Factor aborde la cotation ESG en exploitant le spectre intégral des éléments de mesure « financièrement significatifs » pour isoler les facteurs de durabilité à long terme d'importance dans l'ensemble des dimensions que sont l'environnement, le capital humain, le capital social, le modèle économique, le leadership et la gouvernance d'entreprise.

La méthodologie d'attribution des scores intègre systématiquement les meilleures données (« best-in-class »), un cadre de durabilité transparent, l'importance relative des différents secteurs d'activité sur le plan financier et des normes de gouvernance d'entreprise et ce, afin de définir un score R-Factor pour chaque entreprise.

### ● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

N/A – première période de référence. Pas d'élément de comparaison disponible.

### ● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

### ● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

— *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

S/O

— *Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :*

S/O

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les

*La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.*

*Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.*

*Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.*



### **Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?**

Le Compartiment visait à réduire les externalités négatives causées par les investissements sous-jacents et a, dans ce contexte, examiné les Principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de durabilité en appliquant des filtres ESG basés sur des normes au sein de l'indice. Plus précisément, l'Indice a pris en considération :

- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition à des armes controversées

De plus amples informations sur les PIN sont consultables dans les Rapports périodiques du Compartiment.





### Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

| Investissements les plus importants | Secteur                   | % d'actifs | Pays             |
|-------------------------------------|---------------------------|------------|------------------|
| FORD MOTOR CREDIT CO LLC            | INDUSTRIE                 | 2,96       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES             | INDUSTRIE                 | 2,55       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| CARNIVAL CORP                       | INDUSTRIE                 | 2,43       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| CAESARS ENTERTAIN INC               | INDUSTRIE                 | 2,42       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| OCCIDENTAL PETROLEUM COR            | INDUSTRIE                 | 2,30       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| INTESA SANPAOLO SPA                 | ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS | 2,22       | ITALIE           |
| VODAFONE GROUP PLC                  | INDUSTRIE                 | 2,19       | ROYAUME-UNI      |
| TRANSOCEAN INC                      | INDUSTRIE                 | 2,10       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| COMMSCOPE INC                       | INDUSTRIE                 | 1,96       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| BALL CORP                           | INDUSTRIE                 | 1,72       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| CHEMOURS CO                         | INDUSTRIE                 | 1,62       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| ARCONIC CORP                        | INDUSTRIE                 | 1,50       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| GOODYEAR TIRE + RUBBER              | INDUSTRIE                 | 1,42       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| UNICREDIT SPA                       | ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS | 1,29       | ITALIE           |
| ONEMAIN FINANCE CORP                | ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS | 1,26       | ÉTATS-UNIS (LES) |





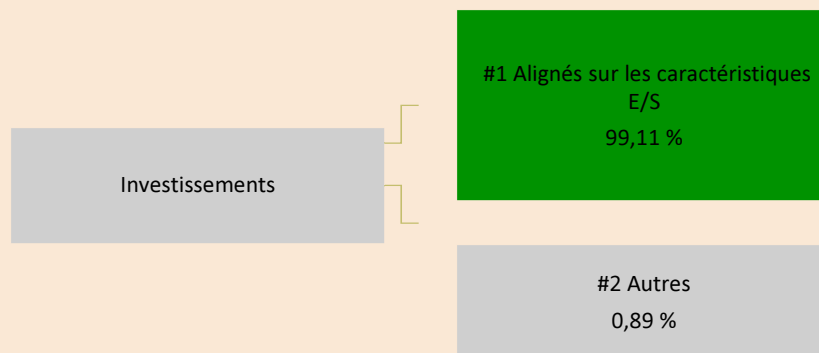
**L'allocation des actifs** décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

## Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-après – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

### ● Quelle était l'allocation des actifs ?

99,11 % des actifs du Fonds ont été investis en titres classés sous la catégorie « #1 Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales » comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 0,89 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie « #2 Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives en matière de sécurité et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie « **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** » comprend :

- la sous-catégorie « **#1A Durables** » couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie « **#1B Autres caractéristiques E/S** » couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

### ● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

| Secteur / Sous-secteur              | % d'allocation |
|-------------------------------------|----------------|
| <b>INDUSTRIE</b>                    | <b>87,87</b>   |
| SECTEURS DE BASE                    | 8,85           |
| BIENS D'ÉQUIPEMENT                  | 8,93           |
| COMMUNICATIONS                      | 10,28          |
| BIENS DE CONSOMMATION CYCLIQUES     | 26,98          |
| BIENS DE CONSOMMATION NON CYCLIQUES | 7,40           |
| ÉNERGIE                             | 13,70          |
| INDUSTRIE – AUTRES                  | 0,30           |

|  |              |
|--|--------------|
| TECHNOLOGIE  | 8,68         |
| TRANSPORT  | 2,75         |
| <b>ÉTABLISSEMENTS FINANCIERS</b>                   | <b>10,47</b> |
| BANQUES  | 3,92         |
| COURTAGE – GESTION D’ACTIFS –<br>BOURSES DE VALEUR | 0,16         |
| SOCIÉTÉS FINANCIÈRES                               | 1,93         |
| FINANCE – AUTRES                                   | 0,37         |
| ASSURANCE  | 0,12         |
| FONDS DE PLACEMENT IMMOBILIER (REIT)               | 3,97         |
| <b>SERVICES AUX COLLECTIVITÉS</b>                  | <b>1,25</b>  |
| FOURNISSEURS D’ÉLECTRICITÉ                         | 1,25         |
| <b>ÉQUIVALENTS DE TRÉSORERIE</b>                   | <b>0,89</b>  |



**Dans quelle mesure minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l’UE ?**

Pour l’heure, le Compartiment ne s’est pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du Règlement taxinomie.

- **Le produit financier investissait-il dans des activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l’énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l’UE<sup>1</sup> ?**

**Oui :**

Dans le gaz fossile  Dans l’énergie nucléaire

**Non**

<sup>1</sup> Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l’énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l’UE uniquement si elles contribuent à l’atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l’un quelconque des objectifs de la taxinomie de l’UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L’ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l’énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l’UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

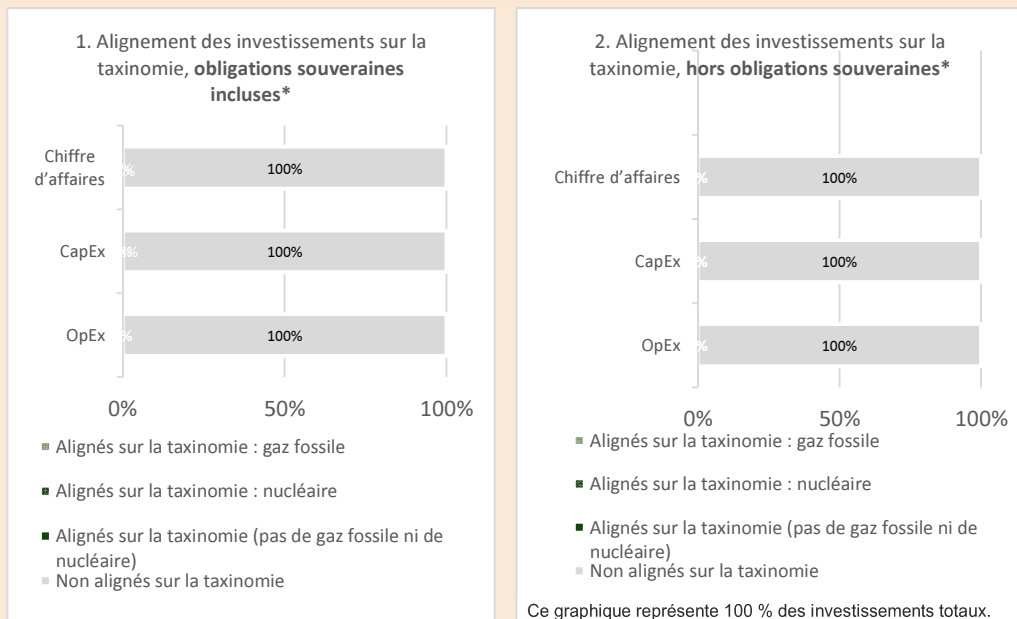
Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;

- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple.

- **dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

**Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines\* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.**



\* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

**Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du Règlement taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

**Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

N/A – première période de référence. Pas d'élément de comparaison disponible.

**Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE.

**Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?**

S/O

Le symbole  représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement UE 2020/852.



### **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?**

Le Compartiment détenait 0,89 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire d'investissement, classés sous la catégorie « #2 Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



### **Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Compartiment réplique le plus fidèlement possible la performance de l'Indice (ou de tout autre indice déterminé par les Administrateurs le cas échéant pour répliquer substantiellement le même marché que l'Indice), tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart entre sa performance et celle de l'Indice.

La politique d'investissement du Compartiment consiste à reproduire la performance de l'Indice. Le Compartiment investit au moins 90 % de ses actifs dans des titres qui composent l'Indice, tandis que le Fournisseur d'indice applique des notations ESG à toutes les composantes de l'Indice.

Le Compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales via l'utilisation de filtres qui visent à exclure les titres liés à certains secteurs, certaines entreprises ou pratiques, sur la base de critères ESG spécifiques, et l'adoption d'une approche « best-in-class » sur la base de la performance ESG en comparaison des univers d'investissement et/ou des homologues du secteur lorsqu'ils sont évalués selon des critères objectifs au sein de l'Indice.

La méthodologie de l'Indice prévoit une révision et un rééquilibrage mensuels.

Les sociétés que le Fournisseur d'indice juge ne pas contrevenir aux principes du PMNU sont réputées faire preuve de bonne gouvernance. Pour toutes informations sur les méthodologies utilisées dans la construction de l'Indice et davantage de renseignements sur les critères d'exclusion et les sources de données, veuillez vous référer au descriptif concernant la méthodologie indiciaire de l'indice Bloomberg qui peut être consulté sur le lien suivant :

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>



### **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence durable ?**

L'objectif du Compartiment consiste à fournir aux investisseurs un rendement total, en tenant compte à la fois des rendements de capital et des revenus, qui reflète généralement le rendement de l'Indice.

La politique d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'Indice aussi étroitement que possible, tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice de 12 mois clôturé au 31 mars 2023, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a enregistré une performance de -3,32 % sur une base brute de commissions, sous-performant son indice de référence, dont le rendement est ressorti à -3,21 %, de 11 points de base (pb). Le Compartiment a généré une performance de -3,61 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée.

Pour toutes informations sur les méthodologies utilisées dans la construction de l'Indice et davantage de renseignements sur les critères d'exclusion et les sources de données, veuillez vous référer au descriptif concernant la méthodologie indiciaire de Bloomberg, consultable sur le lien suivant :

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

● ***En quoi l'indice de référence diffèrait-il d'un indice de marché large ?***

L'Indice repose sur l'indice Bloomberg US Corporate High Yield Bond Index, qui représente la performance de marché des obligations d'entreprise à haut rendement, à taux fixe et libellées en dollars américains.

L'indice de référence du compartiment (à savoir, l'indice Bloomberg SASB US Corporate High Yield ESG Ex-Controversies Select Index) est un indice à taux fixe et libellé en dollars américains visant à optimiser le score R-Factor™, une notation reflétant le respect des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance (« ESG ») fournie par Street Global Advisors®. L'Indice sélectionne des titres éligibles à l'indice Bloomberg US Corporate High Yield Bond Index, puis vise à exclure certains émetteurs en fonction de leurs caractéristiques ESG, compte tenu de leur score ESG et de leur implication dans certaines activités controversées, comme indiqué dans la méthodologie de l'Indice.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?***

La méthodologie de l'Indice prévoit une révision et un rééquilibrage mensuels.

La politique d'investissement du Compartiment consiste à reproduire la performance de l'Indice. Le Compartiment investit au moins 90 % de ses actifs dans des titres qui composent l'Indice, tandis que le Fournisseur d'indice applique des notations ESG à toutes les composantes de l'Indice.

Le Compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales via l'utilisation de filtres qui visent à exclure les titres liés à certains secteurs, certaines entreprises ou pratiques, sur la base de critères ESG spécifiques, et l'adoption d'une approche « best-in-class » sur la base de la performance ESG en comparaison des univers d'investissement et/ou des homologues du secteur lorsqu'ils sont évalués selon des critères objectifs au sein de l'Indice.

En outre, l'Indice exclut les émetteurs associés à des controverses sur événements extrêmes, aux armes controversées, aux violations des principes du Pacte mondial des Nations unies (« PMNU »), aux armes à feu civiles, à l'extraction de charbon thermique et à l'industrie du tabac.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Le Compartiment a enregistré une performance de -3,32 % sur une base brute de commissions, sous-performant l'indice de marché large, dont le rendement est ressorti à -3,20 %, de 12 points de base. Le Compartiment a généré une performance de -3,61 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. La politique d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'Indice aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice. Il n'est pas prévu que le Compartiment réplique l'indice de marché large.

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

**Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852**

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne dresse pas de liste d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

**Dénomination du produit :** SPDR S&P 500 ESG Leaders UCITS ETF (le « Compartiment »)

**Identifiant d'entité juridique :** 5493003SR7FPZA8MG346

## Caractéristiques environnementales et/ou sociales

### Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Oui</b>  | <input type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>Non</b>  |
|--|---|
| <input type="checkbox"/> Il a réalisé <b>des investissements durables ayant un objectif environnemental</b> : ____ %<br><br><input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE<br><br><input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE<br><br><input type="checkbox"/> Il a réalisé <b>des investissements durables ayant un objectif social</b> : ____ % | <input type="checkbox"/> Il a promu des <b>caractéristiques environnementales et sociales (E/S)</b> et, bien que son objectif ne portait pas sur l'investissement durable, il a présenté une proportion de ____ % d'investissements durables<br><br><input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE<br><br><input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE<br><br><input type="checkbox"/> ayant un objectif social<br><br><input checked="" type="checkbox"/> Il a promu des caractéristiques E/S, mais <b>n'a pas réalisé d'investissements durables</b> |





Les indicateurs de durabilité évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

## Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment promeut les facteurs environnementaux et sociaux qui participent aux scores ESG S&P DJI, lesquels sont fonction de l'évaluation et de la notation établies par le fournisseur de l'indice S&P 500 ESG Leaders Index (l'« Indice ») sur diverses caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance pour les entreprises dans l'univers de l'Indice.

Pour plus d'informations sur les scores ESG S&P DJI, veuillez vous référer à la Méthodologie des scores S&P DJI ESG :

<https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-dji-esg-score.pdf> En outre, l'Indice exclut certains titres en fonction de leurs caractéristiques ESG, sur examen de leur notation ESG et de leur implication dans certaines activités commerciales controversées, comme souligné dans la méthodologie de l'Indice en question.

Le Compartiment vise à répliquer l'Indice avec une possible variation annuelle à hauteur de 1 % dans des conditions de marché normales. L'écart de suivi sur un an au 31 mars 2023 ressort à 0,02 %. L'acta de suivi du Compartiment est conforme aux prévisions.

### ● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Compartiment correspondent à la notation ESG, laquelle est formée par les données collectées auprès des entités émettrices et basée sur la cotation ESG issue des scores ESG S&P DJI établis par le fournisseur de l'Indice.

### ● ... et par rapport aux périodes précédentes ?

N/A – première période de référence. Pas d'élément de comparaison disponible.

### ● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement sur la taxinomie.

### ● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

— Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

S/O

— Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

S/O

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



## **Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?**

Le Compartiment visait à réduire les externalités négatives causées par les investissements sous-jacents et a, dans ce contexte, examiné les Principales incidences négatives (« PIN ») sur les facteurs de durabilité en appliquant des filtres ESG basés sur des normes au sein de l'indice. Plus précisément, l'Indice a pris en considération :

- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition à des armes controversées

De plus amples informations sur les PIN sont consultables dans les Rapports périodiques du Compartiment.





### Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

| Investissements les plus importants | Secteur                       | % d'actifs | Pays             |
|-------------------------------------|-------------------------------|------------|------------------|
| APPLE INC                           | TECHNOLOGIES D L'INFORMATION  | 9,46       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| MICROSOFT CORP                      | TECHNOLOGIES D L'INFORMATION  | 8,62       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| AMAZON.COM INC                      | CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE  | 4,04       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| NVIDIA CORP                         | TECHNOLOGIES D L'INFORMATION  | 3,07       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| ALPHABET INC CL A                   | SERVICES DE COMMUNICATION     | 2,73       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| UNITEDHEALTH GROUP INC              | SOINS DE SANTÉ                | 2,51       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| ALPHABET INC CL C                   | SERVICES DE COMMUNICATION     | 2,45       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| EXXON MOBIL CORP                    | ÉNERGIE                       | 2,16       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| JPMORGAN CHASE + CO                 | FINANCES                      | 2,07       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| VISA INC CLASS A SHARES             | FINANCES                      | 1,90       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| PROCTER + GAMBLE CO/THE             | BIENS DE CONSOMMATION DE BASE | 1,79       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| ABBVIE INC                          | SOINS DE SANTÉ                | 1,57       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| ELI LILLY + CO                      | SOINS DE SANTÉ                | 1,48       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| MERCK + CO. INC.                    | SOINS DE SANTÉ                | 1,34       | ÉTATS-UNIS (LES) |
| PEPSICO INC                         | BIENS DE CONSOMMATION DE BASE | 1,29       | ÉTATS-UNIS (LES) |

---



---



---



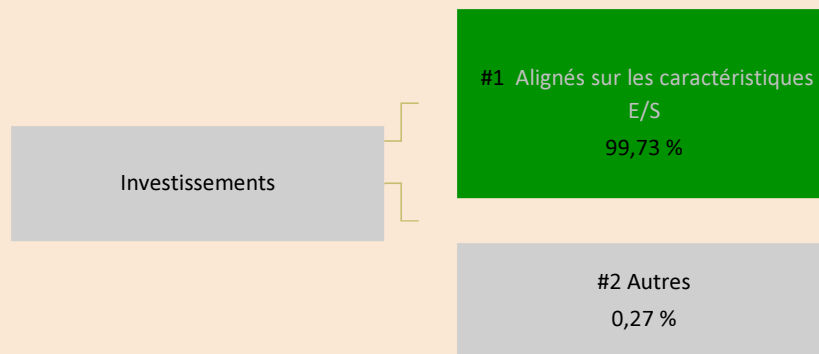
**L'allocation des actifs** décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

## Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-après – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

### ● Quelle était l'allocation des actifs ?

99,73 % des actifs du Fonds ont été investis en titres classés sous la catégorie « #1 Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales » comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 0,27 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie « #2 Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie « **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** » comprend :

- la sous-catégorie « **#1A Durables** » couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie « **#1B Autres caractéristiques E/S** » couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives en matière de sécurité et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres,

### ● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

| Secteur / Sous-secteur                          | % d'allocation |
|---|----------------|
| <b>TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION</b>            | <b>29,09</b>   |
| ÉQUIPEMENT DE COMMUNICATION                     | 1,60           |
| ÉQUIP., INSTRUMENTS ET COMPOSANTS ÉLECTRONIQUES | 0,84           |
| SEMI-CONDUCTEURS ET ÉQUIPEMENTS ASSOCIÉS        | 5,05           |
| LOGICIELS                                       | 11,83          |

dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

|  |              |
|--|--------------|
| ÉQUIP., STOCKAGE ET PÉRIPH.INFORMATIQUES                         | 9,78         |
| <b>SOINS DE SANTÉ</b>  | <b>13,63</b> |
| BIOTECHNOLOGIE   | 4,08         |
| ÉQUIPEMENT ET PRODUITS POUR LES SOINS DE SANTÉ                   | 1,42         |
| SERVICES ET PRESTATAIRES DE SERVICES POUR LE SECTEUR DE LA SANTÉ | 4,20         |
| SCIENCES DE LA VIE   | 0,68         |
| LABORATOIRES PHARMACEUTIQUES                                     | 3,25         |
| <b>FINANCES</b>  | <b>13,03</b> |
| BANQUES  | 4,52         |
| MARCHÉS DE CAPITAUX  | 3,98         |
| CRÉDIT À LA CONSOMMATION   | 0,76         |
| SERVICES FINANCIERS  | 1,90         |
| ASSURANCE  | 1,87         |
| <b>SERVICES DE COMMUNICATION</b>                                 | <b>9,31</b>  |
| SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATION DIVERSIFIÉS                        | 1,84         |
| DIVERTISSEMENTS  | 1,37         |
| MÉDIAS INTERACTIFS ET SERVICES                                   | 5,18         |
| MÉDIAs   | 0,92         |
| <b>CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</b>                              | <b>9,30</b>  |
| PIÈCES AUTOMOBILES   | 0,20         |
| AUTOMOBILES  | 0,56         |
| DÉTAILLANTS DE GAMME COMPLÈTE                                    | 4,26         |
| HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS                                   | 2,29         |
| BIENS DE CONSOMMATION DURABLES                                   | 0,04         |
| PRODUITS DE LOISIRS  | 0,04         |
| DÉTAILLANTS SPÉCIALISÉS  | 1,15         |
| TEXTILES, HABILLEMENT ET PROD. DE LUXE                           | 0,75         |
| <b>BIENS DE CONSOMMATION DE BASE</b>                             | <b>8,19</b>  |
| BOISSONS   | 2,56         |
| DISTRIBUTEURS ET DÉTAILLANTS DE BIENS DE CONSOMMATION DE BASE    | 0,34         |
| DÉTAILLANTS DE PRODUITS DE BASE ET ALIMENTAIRES                  | 1,32         |
| PRODUITS ALIMENTAIRES  | 1,54         |
| ARTICLES DE MÉNAGE   | 2,13         |
| PRODUITS D'HYGIÈNE PERSONNELLE                                   | 0,31         |
| <b>INDUSTRIE</b>   | <b>7,58</b>  |
| TRANSPORT AÉRIEN ET LOGISTIQUE                                   | 0,83         |
| PRODUITS DE CONSTRUCTION   | 0,62         |
| FOURNITURES DE BIENS ET SERV.COMMERCIAUX                         | 0,49         |
| ÉQUIPEMENT ÉLECTRIQUE  | 0,84         |
| MACHINES-OUTILS  | 3,05         |
| SERVICES PROFESSIONNELS  | 0,20         |
| ROUTE ET RAIL  | 1,26         |
| SOCIÉTÉS DE NÉGOCE ET DE DISTRIBUTION                            | 0,29         |

|  |             |
|--|-------------|
| <b>ÉNERGIE</b>                             | <b>4,10</b> |
| ÉQUIPEMENT ET SERVICES ÉNERGÉTIQUES        | 0,65        |
| PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES               | 3,46        |
| <b>MATÉRIAUX</b>                           | <b>2,42</b> |
| PRODUITS CHIMIQUES                         | 1,78        |
| CONTENANTS ET PRODUITS D'EMBALLAGE         | 0,15        |
| MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE             | 0,49        |
| <b>IMMOBILIER</b>                          | <b>2,20</b> |
| REIT – SECTEUR DE LA SANTÉ                 | 0,36        |
| REIT – HÔTELS ET COMPLEXES DE VILLÉGIATURE | 0,06        |
| REIT – INDUSTRIE                           | 0,50        |
| REIT – BUREAUX                             | 0,06        |
| GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE           | 0,14        |
| REIT – RÉSIDENTIEL                         | 0,14        |
| REIT – COMMERCE DE DÉTAIL                  | 0,15        |
| REIT SPÉCIALISÉS                           | 0,79        |
| <b>SERVICES AUX COLLECTIVITÉS</b>          | <b>0,87</b> |
| SERVICES AUX COLLECTIVITÉS – ÉLECTRICITÉ   | 0,28        |
| SERVICES MULTIPLES AUX COLLECTIVITÉS       | 0,44        |
| SERVICES AUX COLLECTIVITÉS – EAU           | 0,15        |
| <b>ÉQUIVALENTS DE TRÉSORERIE</b>           | <b>0,27</b> |



**Dans quelle mesure minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie.

- **Le produit financier investissait-il dans des activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE<sup>1</sup> ?**

Oui :

Dans le gaz fossile  Dans l'énergie nucléaire

**Non**

<sup>1</sup> Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

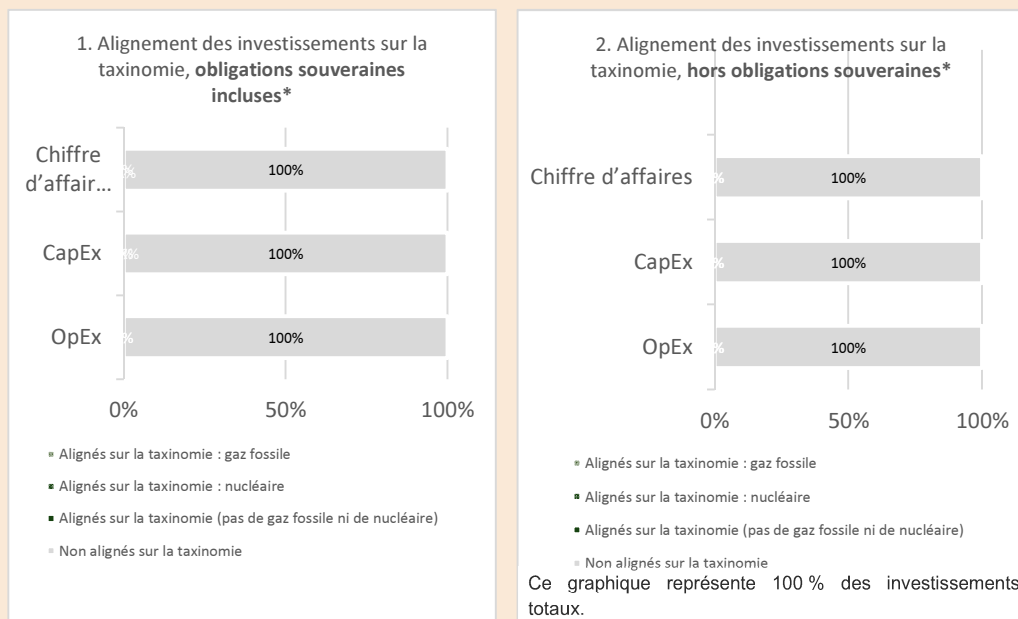
Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;

- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple.

- **dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

**Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines\* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.**



\* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

**Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du Règlement taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

**Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

N/A – première période de référence. Pas d'élément de comparaison disponible.

**Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE.

**Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?**

S/O

Le symbole  représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement UE 2020/852.



### **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?**

Le Compartiment détenait 0,27 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire d'investissement, classés sous la catégorie « #2 Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



### **Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Compartiment promeut les facteurs environnementaux et sociaux qui participent aux scores ESG S&P DJI, lesquels sont fonction de l'évaluation et de la notation établies par le Fournisseur d'indice sur diverses caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance pour les entreprises comprises dans l'univers de l'Indice.

Pour plus d'informations sur les scores ESG S&P DJI, veuillez vous référer à la Méthodologie des scores S&P DJI ESG :

<https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-dji-esg-score.pdf> En outre, l'Indice exclut certains titres en fonction de leurs caractéristiques ESG, sur examen de leur notation ESG et de leur implication dans certaines activités commerciales controversées, comme souligné dans la méthodologie de l'Indice en question.

La politique d'investissement du Compartiment consiste à reproduire la performance de l'Indice. Le Compartiment investit au moins 90 % de ses actifs dans des titres qui composent l'Indice et sont alignés sur des caractéristiques environnementales et/ou sociales, tandis que le Fournisseur d'indice applique des notations ESG à toutes les composantes de l'Indice.

La méthodologie de l'Indice prévoit une révision constante ainsi qu'un rééquilibrage annuel, au moment desquels l'Indice standard est examiné en fonction des critères d'exclusion ESG décrits ci-dessus.

Les entreprises que le Fournisseur d'indice estime observer les Principes du Pacte mondial des Nations Unies sont considérées comme faisant preuve de bonne gouvernance.

Pour plus d'informations, veuillez vous référer à la méthodologie indiciaire : <https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-dji-esg-score.pdf>



### **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence durable ?**

L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance du marché des titres de participation de sociétés américaines de grande capitalisation. La politique d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'Indice aussi étroitement que possible, tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice de 12 mois clôturé au 31 mars 2023, le Compartiment a enregistré

une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a enregistré une performance de -6,12 % sur une base brute de commissions, surperformant son indice de référence, dont le rendement est ressorti à -6,37 %, de 25 points de base (pb). Le Compartiment a généré une performance de -6,22 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée.

Pour toutes informations sur la méthodologie utilisée dans la construction de l'Indice et davantage de renseignements sur les critères d'exclusion et les sources de données, veuillez vous référer au descriptif concernant la méthodologie indiciaire de SPDJI.

● ***En quoi l'indice de référence différerait-il d'un indice de marché large ?***

L'Indice repose sur l'indice S&P 500 Index, son indice parent, qui représente la performance de marché des actions des 500 sociétés américaines les plus importantes en termes de capitalisation boursière.

L'indice de référence du compartiment (à savoir, l'indice S&P 500 ESG Leaders Index) vise à refléter la performance d'un sous-ensemble de titres de participation émis par des sociétés représentées dans l'indice parent, tout en excluant certains d'entre eux en fonction de leurs caractéristiques ESG, sur examen de leur notation ESG ainsi que de leur implication dans certaines activités commerciales controversées, précisées dans sa méthodologie.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?***

La méthodologie de l'Indice prévoit une révision constante ainsi qu'un rééquilibrage annuel, au moment desquels l'Indice standard est examiné en fonction des critères d'exclusion ESG décrits ci-dessus.

La politique d'investissement du Compartiment consiste à reproduire la performance de l'Indice. Le Compartiment investit au moins 90 % de ses actifs dans des titres qui composent l'Indice et sont alignés sur des caractéristiques environnementales et/ou sociales, tandis que le Fournisseur d'indice applique des notations ESG à toutes les composantes de l'Indice. L'Indice exclut certains titres en fonction de leurs caractéristiques ESG, compte tenu de leur score ESG et de leur implication dans certaines activités controversées, comme indiqué dans sa méthodologie.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Le Compartiment a enregistré une performance de -6,12 % sur une base brute de commissions, surperformant l'indice de marché large, dont le rendement est ressorti à -8,20 %, de 2,08 %. Le Compartiment a généré une performance de -6,22 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. La politique d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'Indice aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice. Il n'est pas prévu que le Compartiment réplique l'indice de marché large.

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.