

SPDR[®] Bloomberg U.S. Treasury Bond UCITS ETF (Dist)

Fiche produit
Obligations

31 octobre 2024

★ ★ ★

Morningstar Rating™

30 septembre 2024



Objectif du fonds

L'objectif du fonds est de répliquer la performance du marché des bons du Trésor américain.

Description de l'indice

Le Bloomberg U.S. Treasury Bond Index comprend des obligations d'État du Trésor américain, à savoir des obligations du gouvernement américain. Certains bons du Trésor sont exclus du fait de contraintes d'échéance. De plus, certaines émissions spéciales, comme les obligations des pouvoirs locaux et nationaux (SLG) et les TIPS (titres garantis contre l'inflation) du Trésor américain, sont exclues.

Statut Fiscal

SSGA a pour critère de satisfaire à toutes les obligations de déclaration fiscale applicables, et ce pour l'ensemble des ETF SPDR dans les pays suivants. Les demandes sont déposées tout au long de l'exercice en fonction du calendrier requis par chacune des autorités fiscales locales : R.U., Allemagne, Autriche, Suisse.

Pays d'enregistrement

Suisse, Suède, Royaume-Uni, Pays-Bas, Norvège, Luxembourg, Italie, Irlande, France, Finlande, Espagne, Danemark, Autriche, Allemagne

Information sur le fonds

| | |
|------------------------|------------------------------------|
| ISIN | IE00B44CND37 |
| Indice | Bloomberg U.S. Treasury Bond Index |
| Ticker Indiciel | LUATTRUU |
| Type d'Indice | Total Return |
| Nombre De Sous-Jacents | 289 |

Informations Clés

| | |
|----------------------------------|---|
| Date de lancement | 03-juin-2011 |
| Devise de Base | USD |
| Fonds — Devise de Base | USD |
| Total des Frais sur Encours | 0,15 % |
| Traitement des revenus | Distribution semestrielle |
| Méthode de Réplication | Echantillonnage stratifié |
| Conforme à UCITS | Oui |
| Domicile | Irlande |
| Gestionnaire | State Street Global Advisors Europe Limited |
| Gestionnaire délégué | State Street Global Advisors Limited |
| Ombrelle | SSGA SPDR ETFs Europe I plc |
| Encours de la part (en millions) | US\$394,11 |
| Actifs gérés (en millions) | US\$394,11 |
| Eligible ISA | Oui |
| Eligible SIPP | Oui |
| Eligible PEA | Non |

Avant le 1 février 2022, le Fonds s'appelait SPDR Bloomberg Barclays U.S. Treasury Bond UCITS ETF (Dist) et répliquait l'indice Bloomberg Barclays U.S. Treasury Bond.

Cotation

| Bourse | Ticker | Devise de Transaction | Code iNAV | Code Bloomberg | Code Reuters | Code SEDOL |
|-----------------------|--------|-----------------------|-----------|----------------|--------------|------------|
| Deutsche Börse* | SYBT | EUR | INSYBTE | SYBT GY | TSYE.DE | B3SW5W5 |
| London Stock Exchange | TRSY | USD | INSYBT | TRSY LN | TRSY.L | B44CND3 |
| Euronext Paris | TSYE | EUR | INSYBTE | TSYE FP | TSYE.PA | B3Y3TL9 |
| SIX Swiss Exchange | TRSY | CHF | INSYBTC | TRSY SE | TRSY.S | B77M5X5 |
| London Stock Exchange | USTY | GBP | INSYBTP | USTY LN | USTY.L | B6WFJ96 |
| Borsa Italiana | TRSY | EUR | INSYBTE | TRSY IM | TRSY.MI | BYVB5B5 |

*Première Cotation

| Performance | | | | | |
|--|--------|------------|-------|-----------|------------------|
| | Indice | Fonds Brut | Ecart | Fonds Net | Ecart |
| Rendements Annualisés (%) | | | | | |
| 1 An | 8,41 | 8,48 | 0,07 | 8,32 | -0,09 |
| 3 Ans | -2,54 | -2,52 | 0,03 | -2,66 | -0,12 |
| 5 Ans | -0,70 | -0,67 | 0,03 | -0,82 | -0,12 |
| 10 Ans | 1,00 | 1,03 | 0,02 | 0,87 | -0,13 |
| Depuis début | 1,48 | 1,51 | 0,02 | 1,35 | -0,13 |
| Performances Cumulée (%) | | | | | |
| 1 Mois | -2,38 | -2,37 | 0,01 | -2,38 | 0,00 |
| 3 Mois | 0,06 | 0,06 | 0,01 | 0,02 | -0,03 |
| 1 An | 8,41 | 8,48 | 0,07 | 8,32 | -0,09 |
| 2 Ans | 7,74 | 7,82 | 0,09 | 7,50 | -0,24 |
| 3 Ans | -7,44 | -7,36 | 0,08 | -7,78 | -0,33 |
| 5 Ans | -3,44 | -3,32 | 0,12 | -4,04 | -0,60 |
| 10 Ans | 10,47 | 10,74 | 0,27 | 9,09 | -1,38 |
| Depuis début | 21,81 | 22,20 | 0,38 | 19,78 | -2,04 |
| Performances annuelles (%) | | | | | |
| 2024 | 1,36 | 1,42 | 0,06 | 1,29 | -0,07 |
| 2023 | 4,05 | 4,08 | 0,03 | 3,93 | -0,13 |
| 2022 | -12,46 | -12,46 | 0,01 | -12,59 | -0,13 |
| 2021 | -2,32 | -2,32 | 0,00 | -2,47 | -0,14 |
| 2020 | 8,00 | 8,03 | 0,03 | 7,87 | -0,13 |
| 2019 | 6,86 | 6,88 | 0,03 | 6,72 | -0,13 |
| | | | | | Fonds (%) |
| Volatilité (3 Ans) | | | | | 6,59 |
| Tracking Error Annualisée (3 Ans) | | | | | 0,04 |

La performance passée n'est pas représentative de la performance future. Les montants bruts de commissions ne tiennent pas compte et les montants nets de commissions tiennent compte des commissions et des coûts entraînés par l'émission et le rachat de parts, ou par les achats et ventes de celles-ci. Si la performance est calculée sur la base des valeurs liquidatives brutes/nettes qui ne sont pas libellées dans la devise comptable de l'organisme de placement collectif, elle peut varier à la hausse ou à la baisse en fonction des fluctuations de change. Lorsque le Compartiment est fermé conformément à son calendrier officiel concernant la Valeur liquidative (VL), une partie significative des prix des titres sous-jacents pouvant néanmoins être déterminée, une VL technique est calculée. La performance passée indiquée ici a donc été calculée à l'aide d'une VL technique lorsque cela s'est avéré nécessaire, ainsi que la VL officielle du Fonds pour chaque autre jour ouvrable sur la période concernée. Les rendements de performance enregistrés depuis le lancement seront partiels pour l'année civile, si la date de lancement du Fonds en question, ou la date de lancement du Fonds auquel est liée la performance historique (la date retenue étant la plus proche) est incluse dans cette période.

| Caractéristiques | |
|---------------------------------------|-------|
| Nombre de Lignes | 253 |
| Maturité moyenne (en nombre d'années) | 7,66 |
| Convexité Effective | 0,76% |
| Duration effective | 5,92 |
| Taux de Rendement | 4,27% |
| *Rendement des distributions | 3,02% |

* Mesure l'historique du dividende versé par action sur 12 mois, divisé par la VL.
Source : SSGA Les caractéristiques, actifs détenus, allocations géographiques et sectorielles évoquées ici sont valables à la date indiquée au début de cette fiche d'informations et sont sujets à variations. Aucune référence à une entreprise ou un titre spécifique ne doit être interprétée comme une recommandation d'achat, de vente, de détention ou d'investissement indirect dans cette entreprise ou ce titre.

| 10 Premières Participations | Poids (%) |
|----------------------------------|-----------|
| US TREASURY N/B 4.5 11/15/2033 | 1,14 |
| US TREASURY N/B 4 02/15/2034 | 1,09 |
| US TREASURY N/B 0.625 08/15/2030 | 1,09 |
| US TREASURY N/B 4.625 05/15/2034 | 1,05 |
| US TREASURY N/B 3.875 08/15/2033 | 1,04 |
| US TREASURY N/B 4.125 11/15/2032 | 1,00 |
| US TREASURY N/B 2.875 05/15/2032 | 0,96 |
| US TREASURY N/B 3.5 02/15/2033 | 0,95 |
| US TREASURY N/B 3.375 05/15/2033 | 0,95 |
| US TREASURY N/B 1.375 11/15/2031 | 0,95 |

| Répartition par Qualité | Poids (%) |
|-------------------------|-----------|
| Aaa | 0,10 |
| Aa | 99,90 |

La qualité du crédit est basée sur une moyenne de Moody's, S&P et Fitch.

| Repartition Sectorielle | Poids (%) |
|-------------------------|-----------|
| Dette Souveraine | 99,90 |
| Monétaire | 0,10 |

| Tranche de maturité | Poids (%) |
|---------------------|-----------|
| 0 - 1 An | 0,10 |
| 1 - 3 Ans | 34,02 |
| 3 - 5 Ans | 24,58 |
| 5 - 7 Ans | 9,87 |
| 7 - 10 Ans | 11,73 |
| 10 - 20 Ans | 7,76 |
| > 20 Ans | 11,94 |

| Repartition Géographique | Poids (%) |
|--------------------------|-----------|
| États-Unis | 100,00 |

Risque de capital : Investir implique des risques, dont celui d'une perte du capital.
Les performances passées ne constituent pas un indicateur fiable des performances futures.

Nous contacter

Visitez notre site ssga.com/etfs ou contactez un représentant de l'équipe SPDR ETF France. Vous pouvez également contacter notre service client SPDR à l'adresse suivante spdrseurope@ssga.com.

France & Luxembourg

spdretf_france@ssga.com
+33 1 44 45 40 00

Italie

spdretf_italia@ssga.com
+39 0232066 140

Nordics

spdrseurope@ssga.com
+31 (0)20-7181071

Allemagne

spdrsgermany@ssga.com
+49 69 66774 5016

Pays-Bas

spdr_nl@ssga.com
+31 (0)20-7181071

Espagne

spdrseurope@ssga.com
+39 0232066 140

Suisse

spdrsswitzerland@ssga.com
+ 41 (0)44 245 70 00

Royaume-Uni

spdrseurope@ssga.com
+44 (0) 203 395 6888

ssga.com/etfs

Glossaire

Convexité effective Mesure de la courbure de la relation entre les cours et les rendements obligataires, qui reflète la manière dont la durée d'une obligation varie en fonction des fluctuations de taux d'intérêt.

Duration effective Calcul de durée pour les obligations qui intègrent des options. Cette mesure de la durée tient compte du fait que les flux de trésorerie prévisionnels varieront au gré des fluctuations de taux d'intérêt. La durée effective peut être estimée en utilisant une durée modifiée, si une obligation qui intègre des options se comporte comme une obligation non assortie d'option.

Rendement à l'échéance Rendement total anticipé sur une obligation, si l'obligation est détenue jusqu'à sa date d'échéance. Le rendement à l'échéance est considéré comme un rendement obligataire à long terme, mais il est exprimé en taux annuel. En d'autres termes, il s'agit du taux de rentabilité interne (RTI) d'un investissement dans une obligation, si l'investisseur détient l'obligation jusqu'à sa date d'échéance, et si tous les paiements sont réalisés selon l'échéancier prévu.

Taux de distribution Dividendes par action (DPA) annuels du fonds, divisés par le cours de l'action du fonds.

Delta Ce taux mesure la sensibilité des actions. Également appelé élasticité du cours, il représente la relation entre un pourcentage de variation dans le cours de l'action, et le pourcentage de variation correspondant qui est attendu en ce qui concerne le cours convertible.

TER Le Total des frais sur encours constitue une commission appliquée au fonds, exprimée en pourcentage de la valeur liquidative, dont l'objectif est de couvrir les coûts associés à l'exploitation et à la gestion du portefeuille d'actifs.

À l'usage exclusif des clients professionnels et des investisseurs qualifiés. Non destiné à la distribution publique.

Les fonds indiciels négociables en bourse (ETF) sont négociés comme des actions, sont sujets au risque d'investissement et feront l'objet de fluctuations en termes de valeur de marché. La valeur de l'investissement peut changer tant à la hausse qu'à la baisse ; le rendement sur l'investissement est donc variable en conséquence. Les variations des taux de change peuvent avoir une incidence négative sur la valeur, le cours ou le revenu d'un investissement. En outre, il ne peut être garanti qu'un ETF réalisera son objectif

d'investissement.

Communication marketing

Les ETF SPDR sont susceptibles de ne pas être disponibles ou de ne pas vous convenir. Les informations fournies ne constituent pas des conseils d'investissement tel que ce terme est défini dans la Directive concernant les marchés d'instruments financiers (2014/65/UE) et elles ne doivent pas être invoquées en tant que telles. Elles ne constituent en aucune manière une sollicitation d'achat ou une offre de vente d'investissement. Elles ne tiennent pas compte des objectifs d'investissement, des stratégies, des situations fiscales, de l'appétit pour le risque ou des horizons d'investissement donnés des investisseurs existants ou futurs. Le traitement fiscal dépend de circonstances particulières propres à chaque client et est sujet à des évolutions futures.

Si vous recherchez un conseil en investissement, veuillez solliciter votre consultant fiscal et financier, ou autre conseiller professionnel.

Veillez consulter la dernière mise à jour du Document d'information clé (DIC)/ Document d'information clé pour l'investisseur (DICI) et du Prospectus du Fonds avant toute décision d'investissement. Les versions anglaises les plus récentes du Prospectus et du DIC/ DICI sont consultables à l'adresse www.ssga.com. Une synthèse des droits des investisseurs est disponible ici : <https://www.ssga.com/library-content/products/fund-docs/summary-of-investor-rights-ssga-spd-investors-rights-summary.pdf> Veuillez noter que la Société de gestion peut décider de mettre fin aux dispositions relatives à la commercialisation et procéder à la dénotification conformément à l'art. 93a de la directive 2009/65/CE.

Tous les documents liés aux fonds peuvent être retirés à titre gracieux auprès des bureaux du représentant ou de l'agent local, sont disponibles sur le site www.ssga.com, ou peuvent être obtenus sur simple demande adressée à State Street Custodial Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Irlande. SPDR ETFs constitue la plateforme de fonds négociables en bourse (« ETF ») de State Street Global Advisors ; elle est composée de fonds agréés par les Banque centrale d'Irlande en qualité de sociétés d'investissements OPCVM à capital variable.

Les compartiments ne sont pas disponibles pour les investisseurs américains. SSGA SPDR ETFs Europe I plc et SPDR ETFs Europe II plc (« la Société »), sociétés d'investissement à capital variable de type ouvert avec une responsabilité séparée entre leurs compartiments, émettent les ETF SPDR.

La Société est structurée comme un Organisme de placement collectif en valeurs mobilières (OPCVM) conformément à la législation irlandaise et agréée en qualité d'OPCVM par la Banque centrale d'Irlande.

Informations complémentaires

Importantes : - Pour le Royaume-Uni, le présent document a été publié par State Street Global Advisors Limited (« SSGA »). SSGA est agréée et réglementée par la Financial Conduct Authority, et immatriculée sous le Numéro 2509928. N° TVA 5776591 81. Siège social : 20 Churchill Place, Canary Wharf, London, E14 5HJ, Téléphone : 020 3395 6000 Télécopie : 020 3395 6350 Site internet : www.ssga.com. **Pour l'Union européenne**, le présent document a été publié par State Street Global Advisors Europe Limited (« SSGA »), société réglementée par la Banque centrale d'Irlande. Adresse du siège social : 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2. Numéro d'immatriculation 49934 Tél : +353 (0)1 776 3000. Télécopieur : +353 (0)1 776 3300. Site Internet : www.ssga.com.

Représentants locaux et agents payeurs pour les ETF SPDR :

France : State Street Bank International GmbH Paris Branch, Cœur Défense -Tour A, 100, Esplanade du Général de Gaulle, 92931 Paris La Defense Cedex ; **Suisse** : State Street Bank GmbH Munich, Zurich Branch, Beethovenstrasse 19, 8027 Zurich, et le distributeur principal en Suisse, à savoir State Street Global Advisors AG, Beethovenstrasse 19, 8027 Zurich ; **Allemagne** : State Street Global Advisors Europe Limited, Briener Strasse 59, D-80333 Munich ; **Espagne** : Cecabank, S.A. Alcalá 27, 28014 Madrid (Espagne) ; **Danemark** : Nordea Bank Denmark A/S, Issuer Services, Securities Services Hermes Hus, Helgeshøj Allé 33 Postbox 850 DK-0900 Copenhagen C ; **Autriche** : Erste Bank, Graben 21, 1010 Vienne, Autriche ; **Suède** : SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB, Global Transaction Services ST MH1, SE-106 40 Stockholm, Suède.

« Bloomberg » et tous les indices Bloomberg sont des marques de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses filiales, y compris Bloomberg Index Services Limited (« BISL »), l'administrateur de l'indice (collectivement, « Bloomberg ») et ont fait l'objet d'une licence d'utilisation à certaines fins par State Street Bank and Trust Company, par le biais de sa division State Street Global Advisors (« SSGA »). Bloomberg n'est pas affiliée à SSGA, et Bloomberg n'approuve, ne promeut, n'évalue ni ne recommande aucun produit SSGA. Bloomberg ne garantit aucunement le caractère opportun, ni l'exactitude ou l'exhaustivité des données ou informations, quelles qu'elles soient, relatives à un produit SSGA, quel qu'il soit.

L'Indice S&P 500® est un produit de SP Dow Jones Indices LLC ou de ses filiales (« S&P DJI

») et fait l'objet d'une licence d'utilisation par State Street Global Advisors. S&P®, SPDR®, S&P 500®, US 500 et « the 500 » (les 500) sont des marques déposées de Standard & Poor's Financial Services LLC (« S&P ») ; Dow Jones® est une marque déposée de Dow Jones Trademark Holdings LLC (« Dow Jones ») et a été utilisée sous licence par S&P Dow Jones Indices ; et ces marques déposées ont été utilisées sous licence par S&P DJI et concédées en sous-licence à certaines fins par State Street Global Advisors. Le fonds n'est pas sponsorisé, approuvé, vendu ou promu par S&P DJI, Dow Jones, S&P ou leurs sociétés affiliées respectives et aucune desdites parties ne saurait faire valoir l'opportunité d'investir dans le ou lesdits produits, ni ne saurait engager une quelconque responsabilité en cas d'erreur, d'omission ou d'interruption liée à l'un de ces indices.

Les marques de commerce et les marques de service référencées aux présentes appartiennent à leurs propriétaires respectifs. Les fournisseurs de données tiers ne sauraient garantir ni affirmer, sous aucune forme que ce soit, l'exactitude, l'intégrité ou l'actualité des données, et ne sauraient être tenus responsables de dommages d'aucune sorte qui seraient liés à l'usage de ces données. Le destinataire est uniquement autorisé à voir ou recevoir les données d'indice sous la forme dans laquelle elles sont présentées. Le destinataire comprend, reconnaît et accepte qu'utiliser les données d'indice est à ses risques et périls. Le destinataire comprend, reconnaît et accepte que les données d'indice sont fournies «en l'état» et que ni Morningstar UK Limited (Morningstar) ni ses fournisseurs de contenu ne garantissent l'exactitude, l'exhaustivité, l'absence de violation, l'originalité, l'actualité ou toute autre caractéristique des données d'indice. Le destinataire comprend, reconnaît et accepte par ailleurs que les données d'indice lui sont fournies en sa qualité d'investisseur dans des produits financiers uniquement en vertu des obligations réglementaires et à des fins d'information seulement. Vous ne pouvez pas utiliser les données d'indice à des fins commerciales et celles-ci ne peuvent pas être utilisées à des fins d'opérations boursières ou autres en lieu et place d'un abonnement auxdites données d'indice auprès de Morningstar. Ce document ne saurait être reproduit, copié ou transmis en tout ou partie, et son contenu ne saurait être communiqué à des tiers sans l'autorisation expresse écrite de SSGA.

© 2024 State Street Corporation.
Tous droits réservés.
Date d'expiration : 31/10/2025