OBLIGATIONS SUISSES INDEX (OSI)

Aperçu du fonds

Banque dépositaire	Banque Lombard Odier & Cie SA
Année de lancement	Février 1967
Monnaie	CHF
Clôture de l'exercice	30 septembre
Distribution	aucune, capitalisation
Indice de référence	SBI Dom. AAA-BBB
Fortune totale	CHF 110.94 mn
Portefeuille de base	CHF 1.90 md
Nombre de positions	1'101
Source	Bloomberg ISTOBLS istfunds.ch
VNI Catégorie I	CHF 1'510.12
VNI Catégorie II	CHF 1'531.16
VNI Catégorie III	CHF 1'539.06

Gérant du fonds

Gérant du fonds	Lombard Odier AM
Gérant du fonds dès	Décembre 2021
Signataire UNPRI	oui

Souscription / Rachat

Valeur souscription	T + 3 jours
Valeur remboursement	T + 3 jours

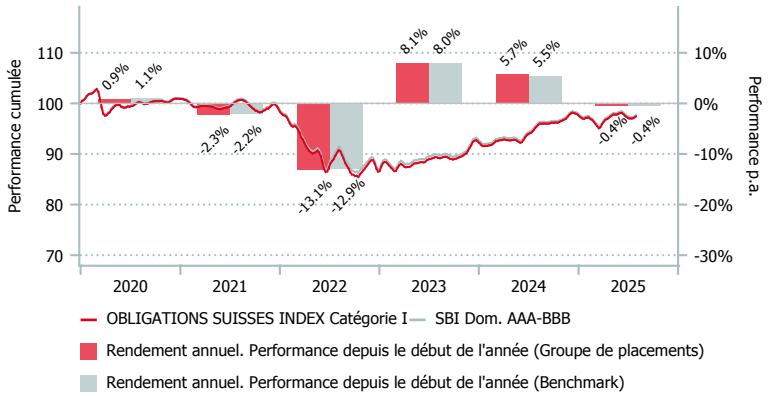
Chiffres clés

Rendement à l'échéance	0.71%
Duration modifiée	7.92 années
Duration benchmark	7.84 années
Tracking Error ex-post	0.22%
Rating moyen	AA+

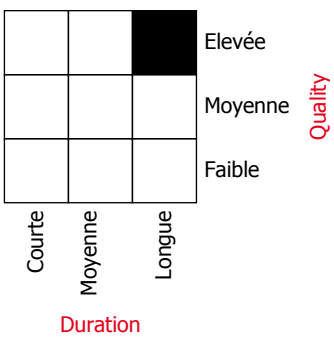
Politique d'investissement

OBLIGATIONS SUISSES INDEX est un groupe de placements investi dans des emprunts libellés en CHF, émis par des débiteurs domiciliés en Suisse et dans la Principauté du Liechtenstein. Il est géré passivement selon la méthode « stratified sampling », l'objectif étant de s'écarter le moins possible de l'indice de référence (Swiss Bond Domestic Total Return Index AAA-BBB). La marge d'erreur maximale ex- ante est de 0.25%. Les créances par débiteur ne doivent pas représenter plus de 10% du patrimoine de la fortune ; cette limite ne s'applique pas aux emprunts de la Confédération et aux titres émis par des institutions de lettres de gage suisses. Tous les placements doivent présenter une notation « investment grade ». Le rating moyen du portefeuille est d'au minimum AA-.

Performance en CHF (en %, nette de frais)



Style Box[1]



	1 m.	3 m.	6 m.	1 a.	3 a.*	5 a.*	Vol. 3 a.
OSI cat. I	0.40	-0.47	0.26	1.94	2.29	-0.63	4.75
OSI cat. II	0.40	-0.46	0.28	1.98	2.33	-0.59	4.75
OSI cat. III	0.41	-0.45	0.30	2.02	2.37	-0.55	4.75
BM	0.40	-0.50	0.29	1.87	2.15	-0.60	4.69

annualisée

	2019	2020	2021	2022	2023	2024	YTD
OSI cat. I	3.25	0.95	-2.32	-13.09	8.05	5.70	-0.44
OSI cat. II	3.34	1.02	-2.28	-13.05	8.09	5.74	-0.42
OSI cat. III	3.38	1.06	-2.24	-13.02	8.14	5.78	-0.39
BM	3.37	1.11	-2.16	-12.88	7.96	5.49	-0.41

OBLIGATIONS SUISSES INDEX (OSI)

Répartition du portefeuille (en %)

Top 10 (en %)

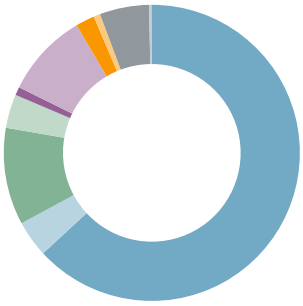
	OSI	BM
4 % Confederation Jan49 06.01.2049	1.5	1.1
4 % Confederation Apr28 08.04.2028	1.3	1.4
2 1/2 Confederation Mar36 08.03.2036	1.2	1.2
1 1/2 Confederation Apr42 30.04.2042	1.2	1.1
3.5% Confederation Apr33 08.04.2033	1.1	1.3
2% Confederation Jun64 25.06.2064	1.0	1.2
1 1/4 Confederation Jun37 27.06.2037	0.9	1.0
1/2 Confederation 45 Regs 28.06.2045	0.8	0.9
0% Confederation 34 REGS 26.06.2034	0.6	0.8
1.25%SWISS CONF JUN43REGS 28.06.2043	0.6	0.6

Débiteurs (en %)

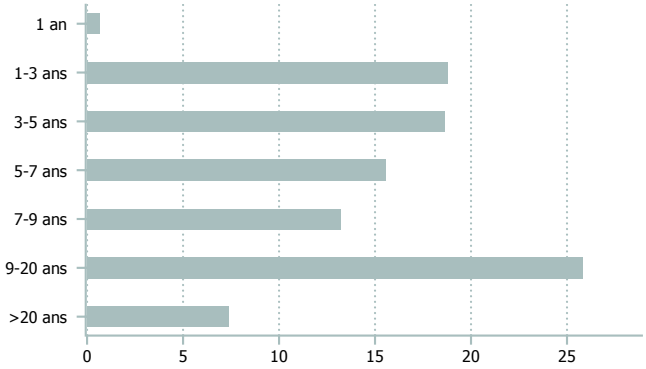
	OSI
Lettres de gage	38.9
Autorités locales	21.7
Treasuries	15.6
Industrie	11.8
Institutions financières	7.6
Services publics	2.4
Agences gouvernementales	1.5
ABS	0.5
Supranational	0.0
Autres (liq. comp.)	0.1

Rating (en %)

	OSI
AAA	63.1
AA+	4.0
AA	10.6
AA-	3.7
A+	0.9
A	9.2
A-	2.1
BBB+	0.7
BBB	5.4
BBB-	0.2
sans rating	0.1



Echéances (en %)



Points de repère

	Catégorie I	Catégorie II	Catégorie III
Numéro de valeur	287.597	2.902.859	2.902.867
ISIN	CH0002875976	CH0029028591	CH0029028674
Investissement minimum en CHF	< 10 Mio.	10 - 30 Mio.	> 30 Mio.
TER KGAST/CAFP[2] en % p.a. au 30.09.2024	0.17	0.13	0.09
dont TER fonds cibles[3] en % p.a. au 30.09.2024	0.04	0.04	0.04
Frais achat / vente en %[4]	0.45/0.00	0.45/0.00	0.45/0.00

[1] *La Style Box décrit graphiquement la stratégie d'investissement dominante d'un fonds.*

[2] *Le ratio des charges d'exploitation TER KGAST/CAFP comprend l'entier des frais avec pour exceptions les coûts de transactions ainsi que le droit de timbre et les taxes de bourse*

[3] *Le TER fonds cibles est composé du TER de chaque fonds cible pondéré par son poids, respectivement des fonds institutionnels de IST. Le chiffre indiqué correspond à la valeur du dernier TER calculé. Il est susceptible d'évoluer à la hausse comme à la baisse dans le futur.*

[4] *en faveur du groupe de placements*

Source de données pour le benchmark: SIX Swiss Exchange