



OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX (OSI)

Eckdaten

Depotbank	Bank Lombard Odier & Co AG
Lancierung	Februar 1967
Währung	CHF
Ende Geschäftsjahr	30. September
Ausschüttung	thesaurierend
Benchmark	SBI Dom. AAA-BBB
Fondsvermögen	CHF 131.59 Mio.
Basisportfolio	CHF 1.66 Mio.
Anzahl Positionen	903
Kursquelle	Bloomberg ISTOBSL istfunds.ch
NAV Kategorie I	CHF 1'366.33
NAV Kategorie II	CHF 1'383.76
NAV Kategorie III	CHF 1'389.27

Fondsmanager

Fondsmanager	Lombard Odier AM
Fondsmanager seit	Dezember 2021
Unterzeichnung UNPRI	ja

Zeichnung / Rücknahme

Valuta Zeichnung	T + 3 Tage
Valuta Rücknahme	T + 3 Tage

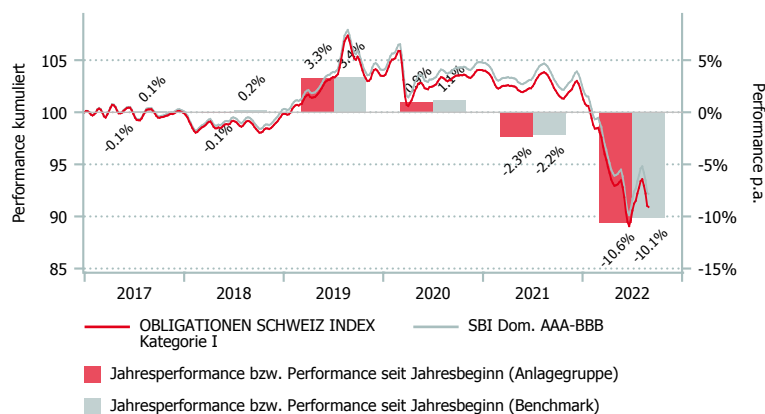
Kennzahlen

Rendite auf Verfall	1.63%
Modified Duration	7.80 Jahre
Tracking Error ex-post	0.18%
Average Rating	AA+

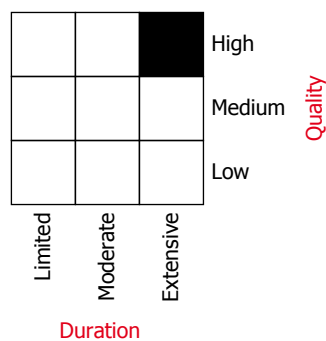
Anlagepolitik

OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX investiert in CHF-Anleihen von Emittenten mit Domizil in der Schweiz und dem Fürstentum Liechtenstein. Die Anlagegruppe wird mittels Stratified-Sampling-Methode passiv verwaltet, mit dem Ziel einer möglichst geringen Abweichung zur Benchmark (Swiss Bond Domestic Total Return Index AAA-BBB). Der maximal zugelassene ex-ante Tracking Error beträgt 0.25%. Die Forderungen gegenüber einem einzelnen Schuldner sind auf maximal 10% begrenzt, aus-genommen für Anleihen der Eidgenossenschaft und der schweizerischen Pfand-briefinstitute. Alle Anlagen müssen mindestens Investment-Grade aufweisen. Das Durchschnittsrating der Anlagegruppe beträgt mindestens AA-.

Performance in CHF (in %, netto nach Kosten)



Morningstar Style-Box™, 1



Quelle: Morningstar

	1 Mt.	3 Mt.	6 Mt.	1 J.	3 J.*	5 J.*	Vol. 3 J.
OSI Kat. I	-3.17	-1.60	-7.48	-12.02	-5.39	-1.96	5.88
OSI Kat. II	-3.17	-1.59	-7.46	-11.98	-5.33	-1.89	5.88
OSI Kat. III	-3.17	-1.58	-7.44	-11.95	-5.30	-1.85	5.88
BM	-3.07	-1.36	-7.11	-11.52	-5.11	-1.71	5.78

*annualisiert

	2016	2017	2018	2019	2020	2021	YTD
OSI Kat. I	1.23	-0.07	-0.07	3.25	0.95	-2.32	-10.58
OSI Kat. II	1.31	0.01	0.01	3.34	1.02	-2.28	-10.56
OSI Kat. III	1.35	0.05	0.05	3.38	1.06	-2.24	-10.53
BM	1.46	0.10	0.20	3.37	1.11	-2.16	-10.14

OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX (OSI)

Aufteilung des Portfolios (in %)

Top 10 (in %)

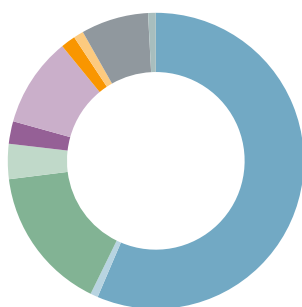
	OSI	BM
4 % Confederation Apr28 08.04.2028	1.6	1.9
1 1/2 Confederation Apr42 30.04.2042	1.3	1.3
4 % Confederation Jan49 06.01.2049	1.2	1.3
2 1/2 Confederation Mar36 08.03.2036	1.2	1.4
1 1/4 Confederation Jun37 27.06.2037	1.1	1.1
3 1/2 Confederation Apr33 08.04.2033	1.0	1.3
2% Confederation Jun64 25.06.2064	0.8	1.2
0% Confederation 39 Regs 24.07.2039	0.7	0.5
0% Pzent Feb29 S529 05.02.2029	0.7	0.2
2 1/4 Confederation Jun31 22.06.2031	0.7	0.9

Schuldner (in %)

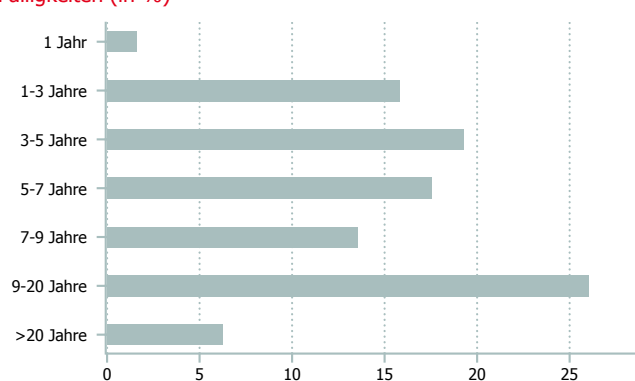
	OSI
Pfandbriefinstitute	39.9
Lokale Behörden	21.6
Treasuries	12.5
Industrie	11.5
Finanzwesen	9.1
Versorgungsbetriebe	2.9
Staatlich und staatsnah	1.7
Supranationale	0.4
ABS	0.3
Sonstige (inkl. Liq.)	0.2

Rating (in %)

Rating	OSI
AAA	56.4
AA+	0.8
AA	15.8
AA-	3.8
A+	2.5
A	9.8
A-	1.6
BBB+	1.1
BBB	7.4
BBB-	0.0
ohne Rating	0.8



Fälligkeiten (in %)



Kategorienübersicht

	Kategorie I	Kategorie II	Kategorie III
Valor	287.597	2.902.859	2.902.867
ISIN	CH0002875976	CH0029028591	CH0029028674
Investitionsgrösse in CHF	< 10 Mio.	10 - 30 Mio.	> 30 Mio.
TER KGAST ² in % p.a. per 30.09.2021	0.24	0.19	0.15
davon TER Zielfonds ³ in % p.a. per 30.09.2021	0.10	0.10	0.10
ex-ante TER ⁴ in % p.a. per 31.12.2021	0.16	0.12	0.08
Gebühren Kauf / Verkauf in % ⁵	0.45/0.00	0.45/0.00	0.45/0.00

¹ Die Morningstar Style Box™ zeigt die Anlagestrategie eines Fonds an. Informationen unter www.morningstar.com.

² Die Betriebsaufwandquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

³ Die TER Zielfonds entsprechen den gewichteten TER der unterliegenden Publikumsfonds respektive der institutionellen Fonds der IST. Die Angabe entspricht der Höhe des zuletzt berechneten TER und bietet keine Gewähr für eine entsprechende Höhe in der Zukunft.

⁴ Die Total Expense Ratio ex ante (TER ex ante) antizipiert alle Kosten, die im Durchschnitt der nächsten 12 Monate bei gleich bleibenden Voraussetzungen dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand).

⁵ zu Gunsten der Anlagegruppe

Datenquelle Benchmark: SIX Swiss Exchange