

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 131.59 mn |
| Portefeuille de base | CHF 1.66 mn |
| Nombre de positions | 903 |
| Source | Bloomberg ISTOBSL istfunds.ch |
| VNI Catégorie I | CHF 1'366.33 |
| VNI Catégorie II | CHF 1'383.76 |
| VNI Catégorie III | CHF 1'389.27 |

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 | 1.63% |
| Duration modifiée | 7.80 années |
| Tracking Error ex-post | 0.18% |
| Rating moyen | AA+ |

Politique d'investissement

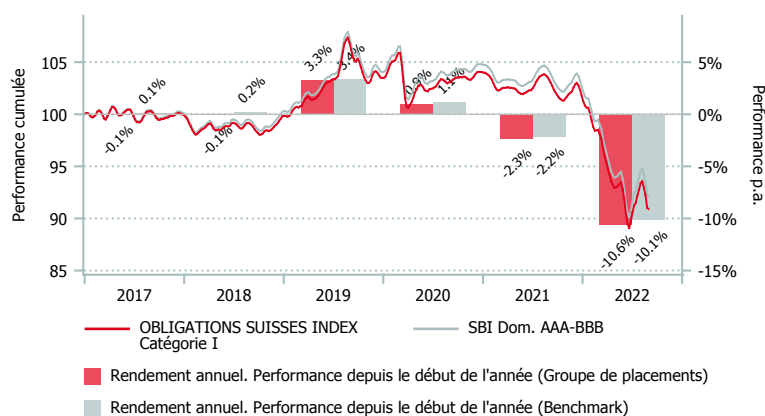
OBLIGATIONS SUISSES INDEX est un groupe de placements investi dans des emprunts libellés en CHF, émis par des débiteurs domiciliés en Suisse et dans la Principauté du Liechtenstein. Il est géré passivement selon la méthode « stratified sampling », l'objectif étant de s'écarter le moins possible de l'indice 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-.

Morningstar Style-Box™, 1

| | | | |
|---------|----------|-----------|----------|
| | | High | Quality |
| | | Medium | |
| | | Low | |
| Limited | Moderate | Extensive | Duration |

Source: Morningstar

Performance en CHF (en %, nette de frais)



| | 1 m. | 3 m. | 6 m. | 1 a. | 3 a.* | 5 a.* | Vol. 3 a. |
|--------------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|-----------|
| OSI cat. I | -3.17 | -1.60 | -7.48 | -12.02 | -5.39 | -1.96 | 5.88 |
| OSI cat. II | -3.17 | -1.59 | -7.46 | -11.98 | -5.33 | -1.89 | 5.88 |
| OSI cat. 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 |

*annualisée

| | 2016 | 2017 | 2018 | 2019 | 2020 | 2021 | YTD |
|--------------|------|-------|-------|------|------|-------|--------|
| OSI cat. I | 1.23 | -0.07 | -0.07 | 3.25 | 0.95 | -2.32 | -10.58 |
| OSI cat. II | 1.31 | 0.01 | 0.01 | 3.34 | 1.02 | -2.28 | -10.56 |
| OSI cat. 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 |

OBLIGATIONS SUISSES INDEX (OSI)

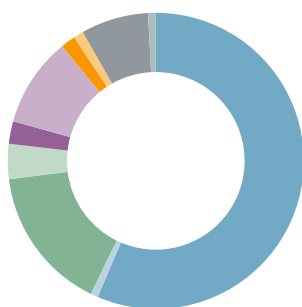
Répartition du portefeuille (en %)

Top 10 (en %)

| | 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 |

Rating (en %)

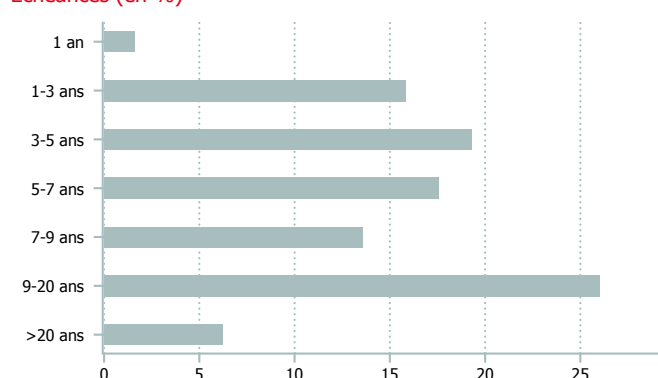
| | OSI |
|-------------|------|
| AAA | 56.4 |
| AA+ | 0.8 |
| AA | 15.8 |
| AA- | 3.8 |
| A+ | 2.5 |
| A | 9.8 |
| A- | 1.6 |
| BBB+ | 1.1 |
| BBB | 7.4 |
| BBB- | 0.0 |
| sans rating | 0.8 |



Débiteurs (en %)

| | OSI |
|--------------------------|------|
| Lettres de gage | 39.9 |
| Autorités locales | 21.6 |
| Treasuries | 12.5 |
| Industrie | 11.5 |
| Institutions financières | 9.1 |
| Services publics | 2.9 |
| Agences gouvernementales | 1.7 |
| Supranational | 0.4 |
| ABS | 0.3 |
| Autres (liq. comp.) | 0.2 |

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 30.09.2021 | 0.24 | 0.19 | 0.15 |
| dont TER fonds cibles ³ en % p.a. au 30.09.2021 | 0.10 | 0.10 | 0.10 |
| ex-ante TER ⁴ en % p.a. au 31.12.2021 | 0.16 | 0.12 | 0.08 |
| Frais achat / vente en % ⁵ | 0.45/0.00 | 0.45/0.00 | 0.45/0.00 |

¹ La Morningstar Style Box™ décrit graphiquement la stratégie d'investissement dominante d'un fonds. Informations sur www.morningstar.com.

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 Le ratio des charges d'exploitation TER ex ante inclut tous les coûts qui seront imputés au groupe de placements dans les 12 prochains mois et à situation inchangée.

⁵ en faveur du groupe de placements

Source de données pour le benchmark: SIX Swiss Exchange