

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 134.78 mn |
| Portefeuille de base | CHF 1.63 md |
| Nombre de positions | 933 |
| Source | Bloomberg ISTOBLS istfunds.ch |
| VNI Catégorie I | CHF 1'392.56 |
| VNI Catégorie II | CHF 1'410.89 |
| VNI Catégorie III | CHF 1'417.07 |

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 |

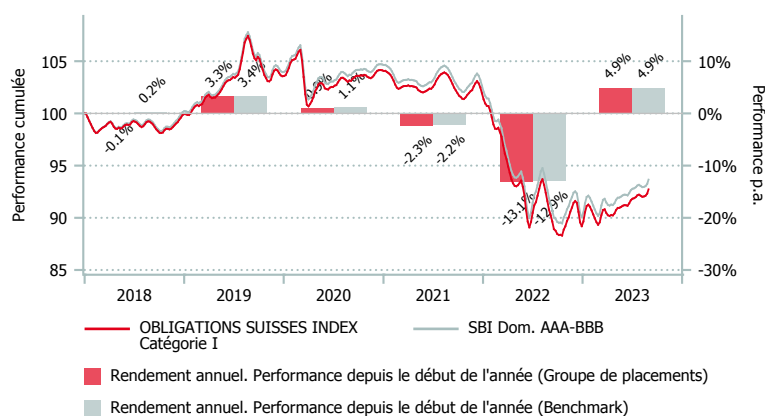
Chiffres clés

| | |
|------------------------|-------------|
| Rendement à l'échéance | 1.73% |
| Duration modifiée | 7.82 années |
| Tracking Error ex-post | 0.23% |
| 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)



Morningstar Style-Box™, 1

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

Source: Morningstar

| | 1 m. | 3 m. | 6 m. | 1 a. | 3 a.* | 5 a.* | Vol. 3 a. |
|--------------|------|------|------|------|-------|-------|-----------|
| OSI cat. I | 0.68 | 0.93 | 3.93 | 1.92 | -3.36 | -1.36 | 5.53 |
| OSI cat. II | 0.69 | 0.94 | 3.96 | 1.96 | -3.32 | -1.30 | 5.53 |
| OSI cat. III | 0.69 | 0.95 | 3.98 | 2.00 | -3.28 | -1.26 | 5.53 |
| BM | 0.66 | 0.83 | 3.98 | 1.72 | -3.21 | -1.19 | 5.46 |

*annualisée

| | 2017 | 2018 | 2019 | 2020 | 2021 | 2022 | YTD |
|--------------|-------|-------|------|------|-------|--------|------|
| OSI cat. I | -0.07 | -0.07 | 3.25 | 0.95 | -2.32 | -13.09 | 4.86 |
| OSI cat. II | 0.01 | 0.01 | 3.34 | 1.02 | -2.28 | -13.05 | 4.88 |
| OSI cat. III | 0.05 | 0.05 | 3.38 | 1.06 | -2.24 | -13.02 | 4.91 |
| BM | 0.10 | 0.20 | 3.37 | 1.11 | -2.16 | -12.88 | 4.91 |

OBLIGATIONS SUISSES INDEX (OSI)

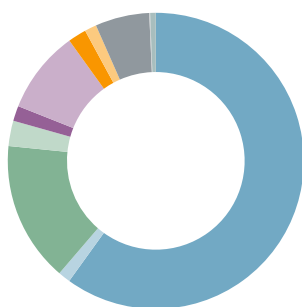
Répartition du portefeuille (en %)

Top 10 (en %)

| | OSI | BM |
|--------------------------------------|-----|-----|
| 4 % Confederation Apr28 08.04.2028 | 1.5 | 1.7 |
| 4 % Confederation Jan49 06.01.2049 | 1.4 | 1.3 |
| 1 1/2 Confederation Apr42 30.04.2042 | 1.3 | 1.2 |
| 2 1/2 Confederation Mar36 08.03.2036 | 1.3 | 1.3 |
| 1 1/4 Confederation Jun37 27.06.2037 | 1.1 | 1.1 |
| 2% Confederation Jun64 25.06.2064 | 1.0 | 1.3 |
| 3.5% Confederation Apr33 08.04.2033 | 0.9 | 1.5 |
| 2 1/4 Confederation Jun31 22.06.2031 | 0.6 | 1.0 |
| 1/2 Confederation 45 Regs 28.06.2045 | 0.6 | 0.9 |
| 1/2 Confederation May30 27.05.2030 | 0.5 | 0.9 |

Rating (en %)

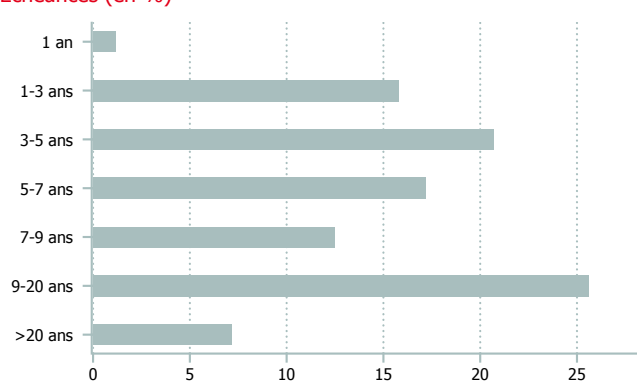
| | OSI |
|-------------|------|
| AAA | 59.9 |
| AA+ | 1.3 |
| AA | 15.3 |
| AA- | 2.8 |
| A+ | 1.7 |
| A | 9.1 |
| A- | 2.0 |
| BBB+ | 1.3 |
| BBB | 5.9 |
| BBB- | 0.1 |
| sans rating | 0.6 |



Débiteurs (en %)

| | OSI |
|--------------------------|------|
| Lettres de gage | 39.6 |
| Autorités locales | 22.6 |
| Treasuries | 13.4 |
| Industrie | 10.3 |
| Institutions financières | 8.0 |
| Services publics | 3.0 |
| Agences gouvernementales | 1.6 |
| ABS | 0.7 |
| Supranational | 0.2 |
| Autres (liq. comp.) | 0.5 |

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 30.09.2022 | 0.16 | 0.12 | 0.08 |
| dont TER fonds cibles ³ en % p.a. au 30.09.2022 | 0.03 | 0.03 | 0.03 |
| Frais achat / vente en % ⁴ | 0.50/0.00 | 0.50/0.00 | 0.50/0.00 |

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 en faveur du groupe de placements

Source de données pour le benchmark: SIX Swiss Exchange