

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 137.25 mn
Portefeuille de base	CHF 1.68 md
Nombre de positions	868
Source	Bloomberg ISTOBSL istfunds.ch
VNI Catégorie I	CHF 1'388.59
VNI Catégorie II	CHF 1'406.16
VNI Catégorie III	CHF 1'411.62

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

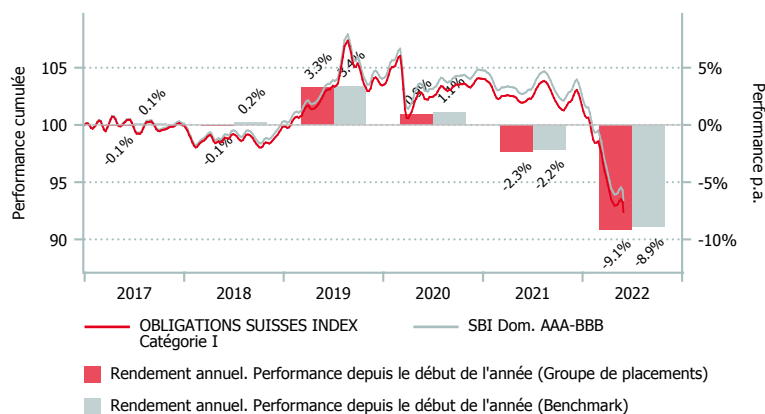
Chiffres clés

Rendement à l'échéance	1.18%
Duration modifiée	7.76 années
Tracking Error ex-post	0.17%
Rating moyen	AA+

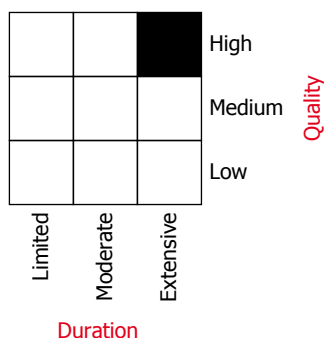
Politique d'investissement

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



Source: Morningstar

	1 m.	3 m.	6 m.	1 a.	3 a.*	5 a.*	Vol. 3 a.
OSI cat. I	-0.66	-5.97	-9.92	-9.38	-3.53	-1.66	5.37
OSI cat. II	-0.66	-5.96	-9.90	-9.34	-3.48	-1.59	5.38
OSI cat. III	-0.66	-5.95	-9.88	-9.30	-3.44	-1.55	5.38
BM	-0.58	-5.83	-9.70	-9.04	-3.32	-1.45	5.27

*annualisée

	2016	2017	2018	2019	2020	2021	YTD
OSI cat. I	1.23	-0.07	-0.07	3.25	0.95	-2.32	-9.13
OSI cat. II	1.31	0.01	0.01	3.34	1.02	-2.28	-9.11
OSI cat. III	1.35	0.05	0.05	3.38	1.06	-2.24	-9.09
BM	1.46	0.10	0.20	3.37	1.11	-2.16	-8.90

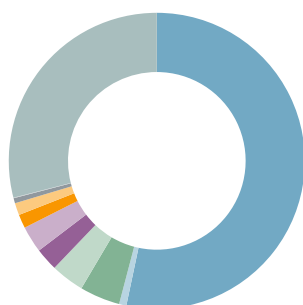
Répartition du portefeuille (en %)

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	1.1	1.2
2 1/2 Confederation Mar36 08.03.2036	1.1	1.3
1 1/4 Confederation Jun37 27.06.2037	1.1	1.1
3 1/2 Confederation Apr33 08.04.2033	1.0	1.3
0% Confederation 39 Regs 24.07.2039	0.7	0.5
2% Confederation Jun64 25.06.2064	0.7	0.9
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 %)

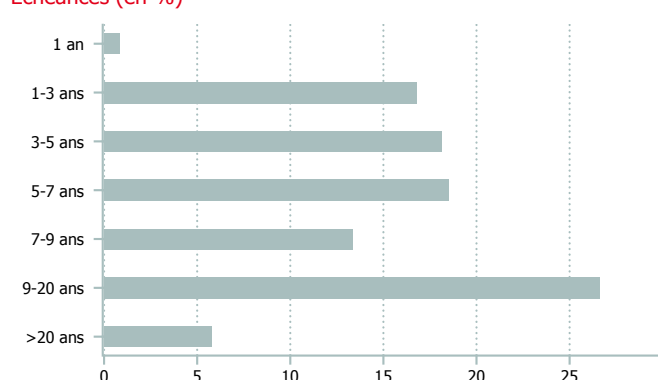
	OSI
AAA	53.3
AA+	0.8
AA	4.4
AA-	3.7
A+	2.5
A	2.9
A-	1.5
BBB+	1.3
BBB	0.6
BBB-	0.1
sans rating	29.0



Débiteurs (en %)

	OSI
Lettres de gage	39.7
Autorités locales	21.6
Treasuries	12.7
Industrie	11.4
Institutions financières	9.2
Services publics	2.9
Agences gouvernementales	1.6
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