

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 122.42 Mio.
Basisportfolio	CHF 1.92 Mrd
Anzahl Positionen	1'065
Kursquelle	Bloomberg ISTOBSL istfunds.ch
NAV Kategorie I	CHF 1'506.26
NAV Kategorie II	CHF 1'526.95
NAV Kategorie III	CHF 1'534.52

Fondsmanager

Fondsmanager	Lombard Odier AM
Fondsmanager seit	Dezember 2021
Unterzeichnung UNPRI	ja

Zeichnung / Rücknahme

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

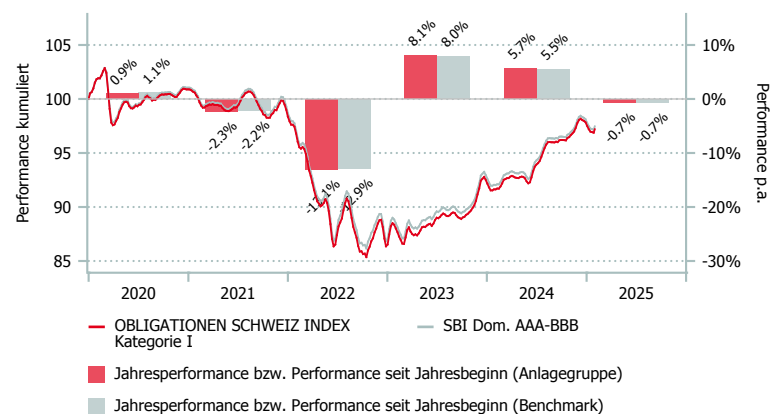
Kennzahlen

Rendite auf Verfall	0.78%
Modified Duration	8.01 Jahre
Benchmark Duration	7.88 Jahre
Tracking Error ex-post	0.24%
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, ausgenommen für Anleihen der Eidgenossenschaft und der schweizerischen Pfandbriefinstitute. Alle Anlagen müssen mindestens Investment-Grade aufweisen. Das Durchschnittsrating der Anlagegruppe beträgt mindestens AA-.

Performance in CHF (in %, netto nach Kosten)



Style Box¹

			Hoch
			Mittel
			Tief
Kurz	Mittel	Lang	Quality
			Duration

	1 Mt.	3 Mt.	6 Mt.	1 J.	3 J.*	5 J.*	Vol. 3 J.
OSI Kat. I	-0.69	0.65	1.68	5.71	0.03	-1.00	5.84
OSI Kat. II	-0.69	0.66	1.70	5.75	0.07	-0.96	5.84
OSI Kat. III	-0.69	0.67	1.72	5.79	0.11	-0.92	5.84
BM	-0.70	0.63	1.58	5.51	0.01	-0.95	5.76

*annualisiert

	2019	2020	2021	2022	2023	2024	YTD
OSI Kat. I	3.25	0.95	-2.32	-13.09	8.05	5.70	-0.69
OSI Kat. II	3.34	1.02	-2.28	-13.05	8.09	5.74	-0.69
OSI Kat. III	3.38	1.06	-2.24	-13.02	8.14	5.78	-0.69
BM	3.37	1.11	-2.16	-12.88	7.96	5.49	-0.70

OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX (OSI)

Aufteilung des Portfolios (in %)

Top 10 (in %)

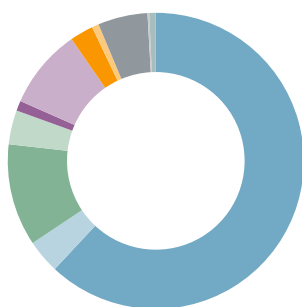
	OSI	BM
4 % Confederation Jan49 06.01.2049	1.5	1.1
4 % Confederation Apr28 08.04.2028	1.4	1.5
2 1/2 Confederation Mar36 08.03.2036	1.3	1.3
1 1/2 Confederation Apr42 30.04.2042	1.2	1.1
3.5% Confederation Apr33 08.04.2033	1.0	1.4
2% Confederation Jun64 25.06.2064	0.9	1.2
1 1/4 Confederation Jun37 27.06.2037	0.9	1.0
1/2 Confederation 45 Regs 28.06.2045	0.8	0.9
2 1/4 Confederation Jun31 22.06.2031	0.6	0.9
1 1/2 Swiss Conf Oct 38REGS 26.10.2038	0.6	0.7

Schuldner (in %)

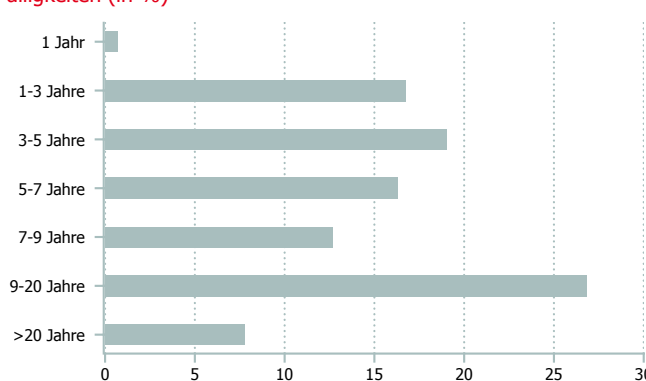
	OSI
Pfandbriefinstitute	38.4
Lokale Behörden	21.6
Treasuries	15.0
Industrie	11.5
Finanzwesen	8.4
Versorgungsbetriebe	2.5
Staatlich und staatsnah	1.6
ABS	0.5
Supranationale	0.0
Sonstige (inkl. Liq.)	0.4

Rating (in %)

	OSI
AAA	62.0
AA+	3.7
AA	11.2
AA-	3.7
A+	1.1
A	8.7
A-	2.6
BBB+	0.8
BBB	5.4
BBB-	0.2
ohne Rating	0.7



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 30.09.2024	0.17	0.13	0.09
davon TER Zielfonds ³ in % p.a. per 30.09.2024	0.04	0.04	0.04
Gebühren Kauf / Verkauf in % ⁴	0.50/0.00	0.50/0.00	0.50/0.00

¹ Die Style Box zeigt die Anlagestrategie eines Fonds an.

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 Publikumfonds 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 zu Gunsten der Anlagegruppe

Datenquelle Benchmark: SIX Swiss Exchange