

## OBLIGATIONEN AUSLAND CHF (OAF)

### Eckdaten

|                     |                                  |
|---------------------|----------------------------------|
| Depotbank           | Bank Lombard Odier & Co AG       |
| Lancierung          | November 1981                    |
| Währung             | CHF                              |
| Zeichnung/Rücknahme | täglich bis 14 Uhr (T)           |
| Ende Geschäftsjahr  | 30. September                    |
| Ausschüttung        | thesaurierend                    |
| Benchmark           | SBI For. AAA-BBB                 |
| Fondsvermögen       | CHF 16.94 Mio.                   |
| Basisportfolio      | CHF 562.54 Mio.                  |
| Anzahl Positionen   | 125                              |
| Kursquelle          | Bloomberg ISTOBAC<br>istfunds.ch |
| NAV Kategorie I     | CHF 1'490.63                     |
| NAV Kategorie II    | CHF 1'502.83                     |
| NAV Kategorie III   | CHF 1'510.27                     |

### Fondsmanager

|                      |               |
|----------------------|---------------|
| Fondsmanager         | Swiss Life AM |
| Fondsmanager seit    | März 2019     |
| Unterzeichnung UNPRI | ja            |

### Zeichnung / Rücknahme

|                  |            |
|------------------|------------|
| Valuta Zeichnung | T + 2 Tage |
| Valuta Rücknahme | T + 2 Tage |

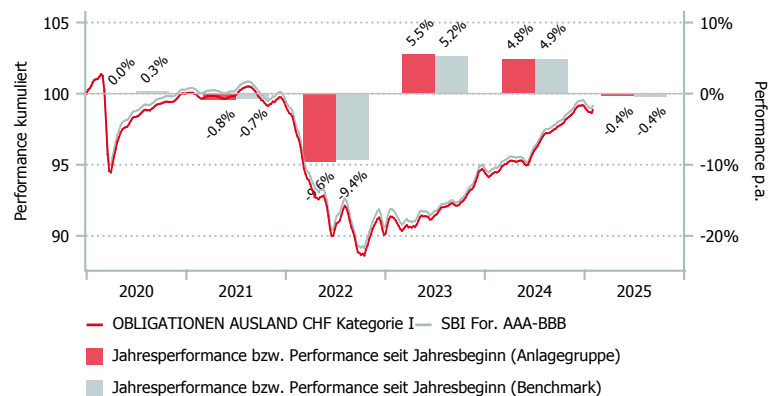
### Kennzahlen

|                        |            |
|------------------------|------------|
| Rendite auf Verfall    | 1.03%      |
| Modified Duration      | 4.32 Jahre |
| Benchmark Duration     | 4.21 Jahre |
| Tracking Error ex-post | 0.34%      |
| Average Rating         | A+         |

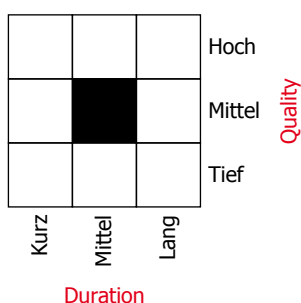
### Anlagepolitik

OBLIGATIONEN AUSLAND CHF ist eine aktiv verwaltete Anlagegruppe mit Anleihen von ausländischen Schuldern in Schweizer Franken. Sofern besondere Marktverhältnisse dies erfordern, dürfen bis zu 20% des Vermögens in auf CHF lautende Forderungspapiere von Schweizer Schuldern angelegt werden. Die Forderungen pro Schuldner dürfen höchstens 10% der Anlagegruppe betragen. Das Portfolio ist breit diversifiziert. Das Durchschnittsrating der Anlagegruppe muss mindestens A- betragen. Die Duration der Anlagegruppe darf maximal 30% von derjenigen der Benchmark abweichen. Als Benchmark wird der Swiss Bond Index Foreign Total Return AAA-BBB angewendet.

### Performance in CHF (in %, netto nach Kosten)



### Style Box<sup>1</sup>



|              | 1 Mt. | 3 Mt. | 6 Mt. | 1 J. | 3 J.* | 5 J.* | Vol. 3 J. |
|--------------|-------|-------|-------|------|-------|-------|-----------|
| OAF Kat. I   | -0.35 | 0.64  | 1.85  | 4.47 | 0.25  | -0.46 | 3.79      |
| OAF Kat. II  | -0.35 | 0.66  | 1.88  | 4.53 | 0.31  | -0.40 | 3.79      |
| OAF Kat. III | -0.35 | 0.67  | 1.90  | 4.57 | 0.35  | -0.36 | 3.79      |
| BM           | -0.42 | 0.63  | 1.87  | 4.41 | 0.20  | -0.39 | 3.81      |

\*annualisiert

|              | 2019 | 2020 | 2021  | 2022  | 2023 | 2024 | YTD   |
|--------------|------|------|-------|-------|------|------|-------|
| OAF Kat. I   | 2.39 | 0.02 | -0.82 | -9.56 | 5.49 | 4.82 | -0.35 |
| OAF Kat. II  | 2.46 | 0.08 | -0.76 | -9.50 | 5.56 | 4.88 | -0.35 |
| OAF Kat. III | 2.50 | 0.12 | -0.72 | -9.47 | 5.60 | 4.92 | -0.35 |
| BM           | 2.13 | 0.30 | -0.72 | -9.38 | 5.23 | 4.86 | -0.42 |

# OBLIGATIONEN AUSLAND CHF (OAF)

## Aufteilung des Portfolios (in %)

### Top 10 (in %)

|  | OAF |
|--|-----|
| Banco Santander SA                           | 5.0 |
| Groupe BPCE                                  | 3.6 |
| Credit Agricole Group                        | 3.6 |
| Münchener Hypothekenbank                     | 3.4 |
| Bank Of Nova Scotia                          | 2.9 |
| BNP Paribas SA, Paris                        | 2.7 |
| National Australia Bank Ltd                  | 2.1 |
| Corp Andina de Fomento                       | 1.9 |
| Confederation Nationale du Credit Mutuel UES | 1.9 |
| Mouvement des caisses Desjardins             | 1.9 |

### Branchen (in %)

|                         | OAF  | BM   |
|-------------------------|------|------|
| Finanzwesen             | 65.4 | 47.9 |
| Staatlich und staatsnah | 7.7  | 16.1 |
| Pfandbriefinstitute     | 5.4  | 15.0 |
| Supranationale          | 4.8  | 0.0  |
| Nicht-Basiskonsumgüter  | 4.6  | 4.7  |
| Versorgungsbetriebe     | 3.6  | 3.0  |
| Industrie               | 3.5  | 5.3  |
| Basiskonsumgüter        | 3.3  | 4.0  |
| Kommunikation           | 0.0  | 1.7  |
| Sonstige (inkl. Liq.)   | 1.8  | 2.3  |

### Länder (in %)

|                             | OAF  | BM   |
|-----------------------------|------|------|
| Frankreich                  | 16.4 | 16.5 |
| Deutschland                 | 14.6 | 14.2 |
| Kanada                      | 11.8 | 11.5 |
| USA                         | 10.6 | 12.8 |
| Spanien                     | 6.8  | 4.6  |
| Europäische Region (ex EUR) | 6.8  | 6.3  |
| Australien                  | 6.0  | 6.0  |
| Schwelienländer Latam       | 5.9  | 4.0  |
| Europäische Region (EUR)    | 5.8  | 11.6 |
| Übrige                      | 15.4 | 12.6 |

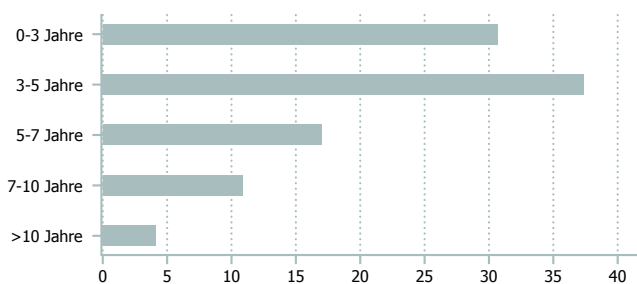


### Rating (in %)

|      | OAF  |
|------|------|
| AAA  | 26.5 |
| AA   | 19.0 |
| A    | 34.4 |
| BBB  | 20.1 |
| <BBB | 0.0  |



### Fälligkeiten (in %)



## Kategorienübersicht

|   | Kategorie I  | Kategorie II | Kategorie III |
|---|--------------|--------------|---------------|
| Valor   | 287.595      | 2.902.885    | 2.902.904     |
| ISIN  | CH0002875950 | CH0029028856 | CH0029029045  |
| Investitionsgrösse in CHF                                 | < 10 Mio.    | 10 - 30 Mio. | > 30 Mio.     |
| TER KGAST <sup>2</sup> in % p.a. per 30.09.2024           | 0.32         | 0.26         | 0.22          |
| davon TER Zielfonds <sup>3</sup> in % p.a. per 30.09.2024 | 0.08         | 0.08         | 0.08          |
| Gebühren Kauf / Verkauf in % <sup>4</sup>                 | 0.07         | 0.07         | 0.07          |

<sup>1</sup> Die Style Box zeigt die Anlagestrategie eines Fonds an.

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

<sup>3</sup> 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.

<sup>4</sup> zu Gunsten der Anlagegruppe

Datenquelle Benchmark: SIX Swiss Exchange