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 16.53 Mio.
Basisportfolio	CHF 690.63 Mio.
Anzahl Positionen	140
Kursquelle	Bloomberg ISTOBAC istfunds.ch
NAV Kategorie I	CHF 1'502.70
NAV Kategorie II	CHF 1'515.37
NAV Kategorie III	CHF 1'523.12

Fondsmanager

Fondsmanager	Swiss Life AM
Fondsmanager seit	März 2019
Unterzeichnung UNPRI	ja

Zeichnung / Rücknahme

Valuta Zeichnung	T + 2 Tage
Valuta Rücknahme	T + 2 Tage

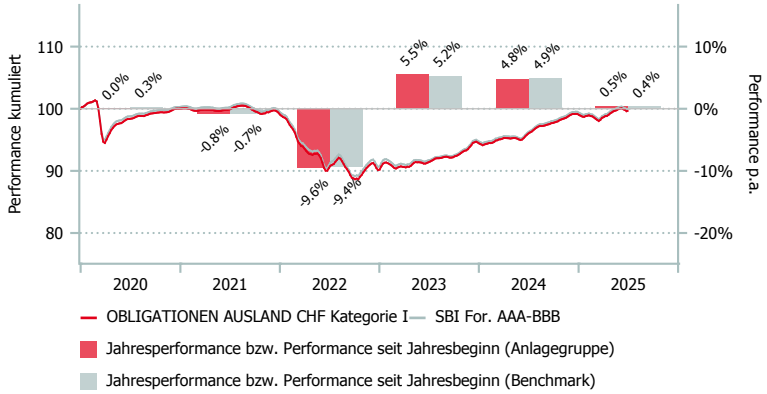
Kennzahlen

Rendite auf Verfall	0.85%
Modified Duration	4.43 Jahre
Benchmark Duration	4.30 Jahre
Tracking Error ex-post	0.31%
Average Rating	A+

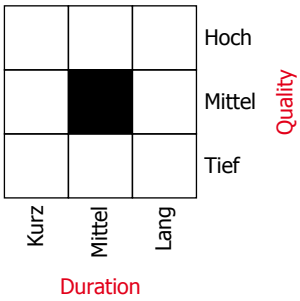
Anlagepolitik

OBLIGATIONEN AUSLAND CHF ist eine aktiv verwaltete Anlagegruppe mit Anleihen von ausländischen Schuldnern in Schweizer Franken. Sofern besondere Marktverhältnisse dies erfordern, dürfen bis zu 20% des Vermögens in auf CHF lautende Forderungspapiere von Schweizer Schuldnern 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[1]



	1 Mt.	3 Mt.	6 Mt.	1 J.	3 J.*	5 J.*	Vol. 3 J.
OAF Kat. I	-0.46	0.83	0.45	3.65	3.19	0.24	2.96
OAF Kat. II	-0.45	0.84	0.48	3.71	3.25	0.30	2.96
OAF Kat. III	-0.45	0.85	0.50	3.75	3.29	0.34	2.96
BM	-0.47	0.80	0.36	3.65	3.11	0.22	2.99

*annualisiert

	2019	2020	2021	2022	2023	2024	YTD
OAF Kat. I	2.39	0.02	-0.82	-9.56	5.49	4.82	0.45
OAF Kat. II	2.46	0.08	-0.76	-9.50	5.56	4.88	0.48
OAF Kat. III	2.50	0.12	-0.72	-9.47	5.60	4.92	0.50
BM	2.13	0.30	-0.72	-9.38	5.23	4.86	0.36

OBLIGATIONEN AUSLAND CHF (OAF)

Aufteilung des Portfolios (in %)

Top 10 (in %)

	OAF
Banco Santander SA	4.4
Credit Agricole Group	3.4
Groupe BPCE	3.4
Bank Of Nova Scotia	3.2
Münchner Hypothekenbank	3.1
BNP Paribas SA, Paris	2.3
Corp. Andina de Fomento	2.0
Landesbank Baden-Wuerttemberg	1.9
National Australia Bank Ltd	1.9
Mouvement des caisses Desjardins	1.8

Branchen (in %)

	OAF	BM
Finanzwesen	62.7	48.3
Staatlich und staatsnah	7.9	16.8
Pfandbriefinstitute	5.7	12.9
Supranationale	4.8	0.0
Nicht-Basiskonsumgüter	4.8	4.2
Basiskonsumgüter	4.1	5.0
Versorgungsbetriebe	3.8	3.8
Industrie	2.8	5.3
Energie	1.3	0.4
Sonstige (inkl. Liq.)	2.1	3.2

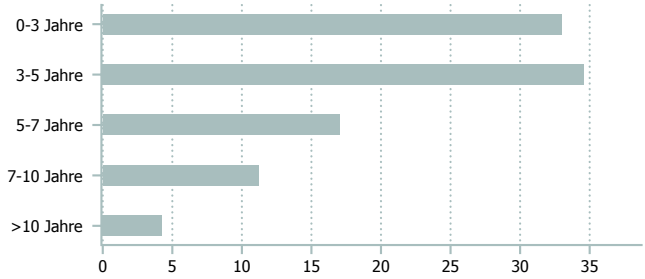
Länder (in %)

	OAF	BM
Frankreich	14.7	16.4
Deutschland	14.3	14.1
USA	12.5	13.4
Kanada	12.5	11.2
Europäische Region (ex EUR)	6.9	6.0
Spanien	6.0	4.6
Australien	5.8	6.0
Schwellenländer Latam	5.7	3.6
Europäische Region (EUR)	5.7	11.6
Übrige	16.1	13.1

Rating (in %)

	OAF
AAA	24.8
AA	19.5
A	36.5
BBB	19.2
<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[2] in % p.a. per 30.09.2024	0.32	0.26	0.22
davon TER Zielfonds[3] in % p.a. per 30.09.2024	0.08	0.08	0.08
Gebühren Kauf / Verkauf in %[4]	0.07	0.07	0.07

[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

IST Investmentstiftung | Manessestrasse 87 | 8045 Zürich | Tel. 044 455 37 00 | Fax 044 455 37 01 | info@istfunds.ch