# 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 94.62 Mio. |
| Basisportfolio | CHF 1.84 Mrd |
| Anzahl Positionen | 1'228 |
| Kursquelle | Bloomberg ISTOBLS<br>istfunds.ch |
| NAV Kategorie I | CHF 1'508.68 |
| NAV Kategorie II | CHF 1'530.47 |
| NAV Kategorie III | CHF 1'539.13 |

## Fondsmanager

| | |
|---|---|
| Fondsmanager | Lombard Odier AM |
| Fondsmanager seit | Dezember 2021 |
| Unterzeichnung UNPRI | ja |

## Zeichnung / Rücknahme

| | |
|---|---|
| Valuta Zeichnung | T + 3 Tage |
| Valuta Rücknahme | T + 3 Tage |

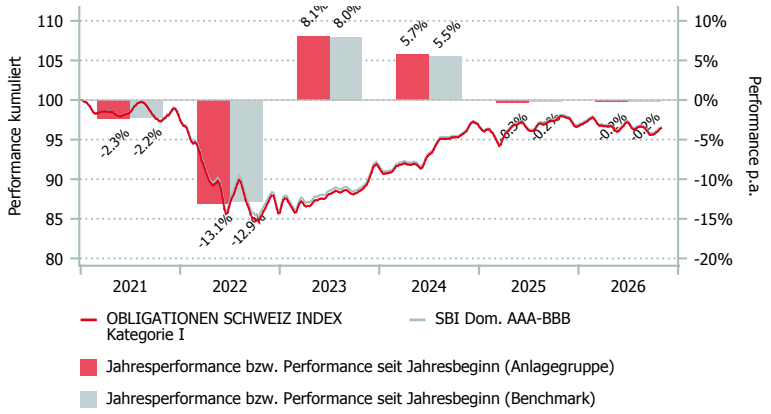
## Kennzahlen

| | |
|---|---|
| Rendite auf Verfall | 0.94% |
| Modified Duration | 7.52 Jahre |
| Benchmark Duration | 7.56 Jahre |
| Tracking Error ex-post | 0.07% |
| Average Rating | AA+ |

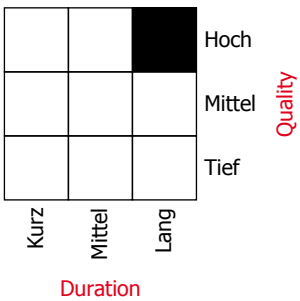
## Anlagepolitik

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 Box[1]




| | 1 Mt. | 3 Mt. | 6 Mt. | 1 J. | 3 J.* | 5 J.* | Vol. 3 J. |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| OSI Kat. I | 0.81 | 0.16 | -0.23 | -1.57 | 2.83 | -0.12 | 3.32 |
| OSI Kat. II | 0.82 | 0.17 | -0.21 | -1.54 | 2.87 | -0.08 | 3.32 |
| OSI Kat. III | 0.82 | 0.18 | -0.19 | -1.50 | 2.91 | -0.04 | 3.32 |
| BM | 0.82 | 0.19 | -0.20 | -1.57 | 2.77 | -0.11 | 3.31 |

*annualisiert*

| | 2020 | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025 | YTD |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| OSI Kat. I | 0.95 | -2.32 | -13.09 | 8.05 | 5.70 | -0.31 | -0.23 |
| OSI Kat. II | 1.02 | -2.28 | -13.05 | 8.09 | 5.74 | -0.27 | -0.19 |
| OSI Kat. III | 1.06 | -2.24 | -13.02 | 8.14 | 5.78 | -0.23 | -0.16 |
| BM | 1.11 | -2.16 | -12.88 | 7.96 | 5.49 | -0.23 | -0.24 |

# OBLIGATIONEN SCHWEIZ INDEX (OSI)

## Aufteilung des Portfolios (in %)

### Top 10 (in %)

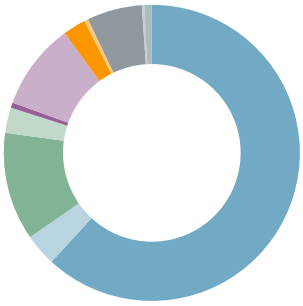
| | OSI | BM |
|---|---|---|
| 4 % Confederation Apr28 08.04.2028 | 1.3 | 1.3 |
| 2 1/2 Confederation Mar36 08.03.2036 | 1.2 | 1.2 |
| 1 1/2 Confederation Apr42 30.04.2042 | 1.1 | 1.1 |
| 4 % Confederation Jan49 06.01.2049 | 1.1 | 1.1 |
| 2% Confederation Jun64 25.06.2064 | 1.0 | 1.2 |
| 1 1/4 Confederation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

### Schuldner (in %)

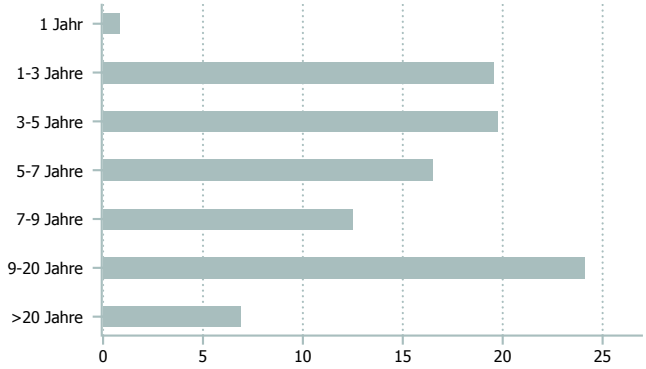
| | OSI |
|---|---|
| Pfandbriefinstitute | 39.1 |
| Lokale Behörden | 20.7 |
| Treasuries | 15.1 |
| Industrie | 12.8 |
| Finanzwesen | 8.0 |
| Versorgungsbetriebe | 2.1 |
| Staatlich und staatsnah | 1.9 |
| ABS | 0.1 |
| Supranationale | 0.0 |
| Sonstige (inkl. Liq.) | 0.3 |

### Rating (in %)

| | OSI |
|---|---|
| AAA | 61.9 |
| AA+ | 3.5 |
| AA | 11.8 |
| AA- | 2.8 |
| A+ | 0.6 |
| A | 9.5 |
| A- | 2.5 |
| BBB+ | 0.4 |
| BBB | 6.0 |
| BBB- | 0.3 |
| ohne Rating | 0.8 |



### 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 30.09.2025 | 0.16 | 0.12 | 0.08 |
| davon TER Zielfonds[3] in % p.a. per 30.09.2025 | 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