Swiss Responsible Bond Index (SRBI)

Factsheet - 31.07.2025

Références

SRBI - Total Return

ISIN	CH1337302322
Symbol	SRBIT
Code RIC	.SRBIT

Points clés

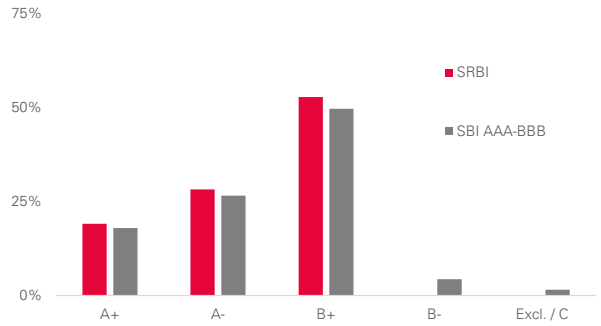
Lancé par Ethos début avril 2024, le Swiss Responsible Bond Index (SRBI) est constitué d'émetteurs compris dans l'indice de référence « Swiss Bond Index AAA-BBB » qui disposent d'une note ESG attribuée par Ethos de A+, A- ou B+ au minimum (sur une échelle allant de A+ à C). Il souhaite ainsi favoriser l'investissement dans les émetteurs qui gèrent avec conviction leurs enjeux ESG et dont la performance extra-financière est meilleure que celle de leurs pairs.

En plus des exclusions liées aux produits et aux comportements des émetteurs, les instruments identifiés par SIX comme étant des titres adossés à des actifs (« Asset backed-securities ») sont également exclus du SRBI.

L'indice SRBI est administré par Ethos, qui est responsable de la détermination des ratings ESG et des critères d'exclusion utilisés, tandis que SIX en assure le calcul selon les standards du marché.

4 variants de l'indice sont calculés: Price Return (PR), Total Return (TR), Yield et Duration.

Répartition des ratings ESG

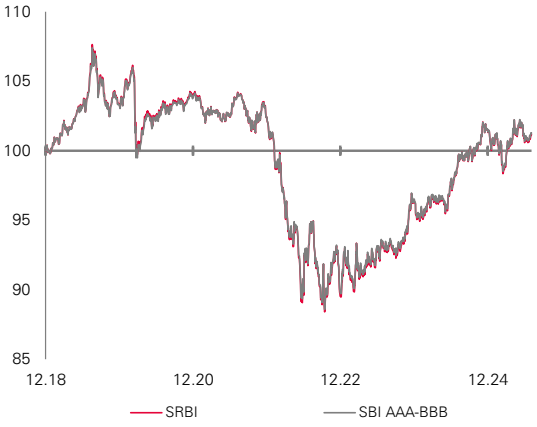


En % de la valeur de marché.

Performance comparée du SRBI TR et du SBI* TR

	SRBI Cumulée	SBI * Cumulée	SRBI Annualisée	SBI * Annualisée
1 mois	0.37%	0.36%	-	-
3 mois	-0.37%	-0.32%	-	-
YTD	-0.27%	-0.20%	-	-
3 ans	6.81%	6.90%	2.22%	2.25%
5 ans	-2.32%	-2.08%	-0.47%	-0.42%
Depuis le 28.12.2018	1.19%	1.28%	0.18%	0.19%

** SBI AAA-BBB*
Lancement le 2.4.2024. Performance précédente: backtest calculé par la SIX depuis le 28.12.2018



La performance historique réalisée ne constitue pas un indicateur des résultats actuels ou futurs.

Top 5 positions

	SRBI	SBI AAA-BBB	Différence
Banque des Lettres de Gage Suisse	17.0%	16.0%	1.0%
Switzerland	15.4%	14.5%	0.9%
Centr. Lettres Gage Banques Cantonales	15.1%	14.2%	0.9%
Canton de Genève	1.4%	1.3%	0.1%
Stadt Zürich	1.3%	1.3%	0.1%

Top 5 exclusions

	SRBI	SBI AAA-BBB	Différence
Bank of Nova Scotia	-	0.4%	-0.4%
Canadian Imperial Bank of Commerce	-	0.3%	-0.3%
AMAG Leasing	-	0.3%	-0.3%
Royal Bank of Canada	-	0.3%	-0.3%
Toronto-Dominion Bank	-	0.3%	-0.3%

Répartition par rating SIX composite

	SRBI	SBI AAA-BBB	Différence
AAA	60.3%	57.6%	2.7%
AA	19.4%	19.0%	0.3%
A	14.4%	15.9%	-1.5%
BBB	5.9%	7.5%	-1.6%
Total	**100.0%**	**100.0%**	

Répartition par maturité

	SRBI	SBI AAA-BBB	Différence
1-3 years	22.4%	23.7%	-1.2%
3-5 years	20.8%	21.7%	-0.9%
5-10 years	32.0%	31.4%	0.7%
>10 years	24.7%	23.2%	1.5%
Total	**100.0%**	**100.0%**	

Ethos Services SA
1 Place de Pont-Rouge, Case postale, CH-1211 Genève 26 - T +41 58 201 89 89
Bureau de Zürich: Glockengasse 18, CH-8001 Zurich - T +41 58 201 89 89
www.ethosfund.ch - info@ethosfund.ch

Signatory of: PRI Principles for Responsible Investment

Disclaimer

Ce document de marketing est émis par Ethos Services SA. Il n'est pas destiné à être distribué ou utilisé par des personnes physiques ou des entités qui seraient citoyennes d'un Etat ou auraient leur résidence dans un lieu, Etat, pays ou juridiction dans lesquels sa distribution, publication, mise à disposition ou utilisation seraient contraires aux lois ou règlements en vigueur. Seule la dernière version du prospectus, des règlements ainsi que du rapport annuel du fonds ou du compartiment de fonds doit être considérée comme une publication sur la base de laquelle se fondent les décisions de placement. Ces documents sont disponibles sur le site www.ethosfund.ch ou auprès de chacun des bureaux Ethos mentionnés ci-dessus. Les informations ou données contenues dans le présent document ne constituent ni une offre, ni une sollicitation à acheter, à vendre ou à souscrire à des titres ou à d'autres instruments financiers. Les informations, avis et évaluations qu'il contient reflètent un jugement au moment de sa publication et sont susceptibles d'être modifiés sans notification préalable. Ethos Services SA n'a pris aucune mesure pour s'assurer que les fonds ou compartiments de fonds auxquels il est fait référence dans le présent document sont adaptés à chaque investisseur en particulier, et ce document ne saurait remplacer un jugement indépendant. La valeur et les revenus tirés des titres ou des instruments financiers mentionnés dans le présent document peuvent fluctuer à la hausse ou à la baisse, et il est possible que les investisseurs ne récupèrent pas la totalité du montant initialement investi. Les facteurs de risque sont décrits dans le prospectus du fonds. Aussi n'est-il pas prévu de les reproduire ici dans leur intégralité. La performance passée ne saurait préjuger ou constituer une garantie des résultats futurs. Les données relatives à la performance n'incluent ni les commissions, ni les frais prélevés lors de la souscription ou le rachat de parts. Ce matériel de marketing n'a pas pour objet de remplacer la documentation détaillée émise par le fonds ou les informations que les investisseurs doivent obtenir du ou des intermédiaires financiers en charge de leurs investissements dans les actions des fonds ou du compartiment de fonds mentionnés dans ce document. Lorsque le portefeuille se compose d'actifs libellés dans d'autres monnaies, le risque lié aux variations des taux de change peut subsister.

The Swiss Responsible Bond Index (SRBI) is proprietary to Ethos and calculated and maintained by SIX Swiss Exchange AG.

SIX Swiss Exchange AG ("SIX Swiss Exchange") is the Calculation Agent of the Swiss Responsible Bond Index. SIX Swiss Exchange has not been involved in any way in the creation of any reported information and does not give any warranty and excludes any liability whatsoever (whether in negligence or otherwise) – including without limitation for the accuracy, adequateness, correctness, completeness, timeliness, and fitness for any purpose – with respect to any reported information or in relation to any errors, omissions or interruptions in the Swiss Responsible Bond Index or its data. Any dissemination or further distribution of any such information pertaining to SIX Swiss Exchange is prohibited.