

# ZKB Basket Sustainable USA

Reporting | Valor 39 941 564

29.03.2024

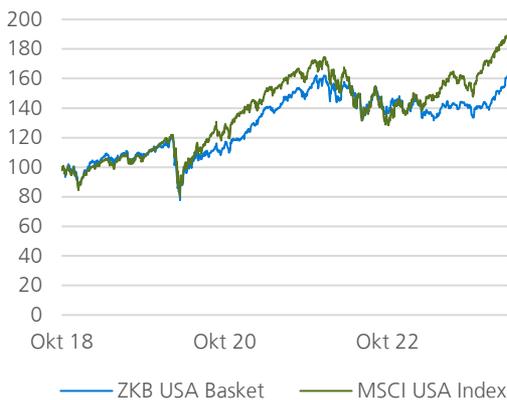
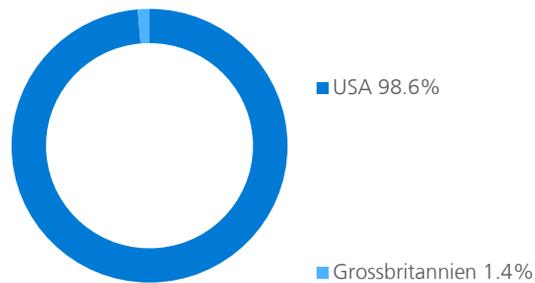
**Hierbei handelt es sich in der Schweiz um Strukturierte Produkte. Sie sind keine kollektiven Kapitalanlagen im Sinne des Kollektivanlagegesetzes (KAG). Sie unterstehen weder der Genehmigungspflicht noch der Aufsicht der FINMA und Anleger geniessen nicht den spezifischen Anlegerschutz des KAG.**

## In Kürze

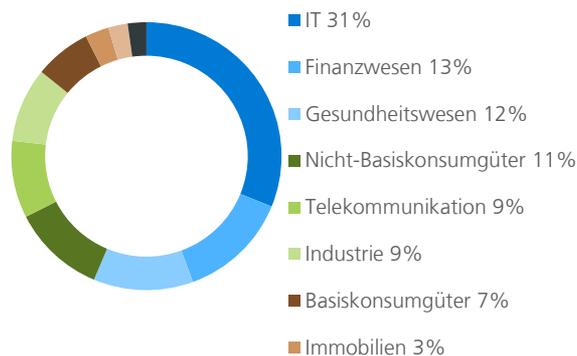
■ Systematische Titelauswahl aus dem nachhaltigen Anlageuniversum der Zürcher Kantonalbank

■ Investition sowohl in Branchenleader punkto Nachhaltigkeit als auch in kleinere Unternehmen mit innovativen, nachhaltigen Produkten (Innovatoren)

Aufteilung nach Region per 29.03.2024



Aufteilung nach Portfoliokategorie per 29.03.2024



## Performancekennzahlen ZKB Basket Sustainable USA

Absolut	Annualisiert	
1Mt	6.3%	
3Mte	14.8%	
1J	16.4%	
3J	17.0%	5.7%
5J	56.2%	11.2%
seit Lancierung	61.2%	11.2%

Jahresperformance	
2015	
2016	
2017	
2018	
2019	27.3%
2020	6.3%
2021	34.2%
2022	-15.7%
2023	2.9%

## Beschreibung

Das Zertifikat investiert in Beteiligungspapiere von Gesellschaften, die ihr Domizil oder die überwiegende Geschäftstätigkeit in den USA haben. Die Auswahl der Gesellschaften erfolgt nach Nachhaltigkeitskriterien und gemäss einem quantitativen Modell. Zur Diversifikation werden im Normalfall zwischen 60 und 90 Positionen gehalten.

Mehrwert schaffen durch nachhaltige Unternehmen  
Wer in nachhaltige Unternehmen investiert, fördert nicht nur nachhaltiges Wachstum in den USA, sondern investiert in Unternehmen, die von langfristigen Trends besser profitieren können oder von neuen Regulierungen weniger stark betroffen sind. Unter den Grossen einer Branche sind es diejenigen, die sich durch geringe Umweltbelastung, soziales Engagement und verantwortungsvolle Unternehmensführung von den anderen abheben. Ein Unternehmen im Bereich Grundstoffe zum Beispiel kann mit effizienteren Herstellungsmethoden einem Anstieg der Rohstoffpreisen entgegenwirken und Kosten senken. Ein Nahrungsmittelhersteller wiederum kann mit gesunden Produkten einen Beitrag zur Bekämpfung von Fettleibigkeit leisten und gleichzeitig von der stark steigenden Nachfrage profitieren. Und nachhaltigere Banken, bei denen die verantwortungsvolle Unternehmensführung im Vordergrund steht, haben sich als krisenresistenter erwiesen. Auch kleinere Unternehmen, die neue Technologien etwa für erneuerbare Energien, effizientere Ressourcennutzung oder den öffentlichen Verkehr entwickeln, gewinnen durch diese Trends.

Kombination von Nachhaltigkeit, Value, Momentum und Quality

Auf Basis des proprietären nachhaltigen Universums (Sustainable-Ansatz) investiert das bewährte quantitative Modell der Zürcher Kantonalbank in Titel, welche die drei Eigenschaften Value, Momentum und Quality am besten verkörpern. Gesucht sind dabei tiefbewertete Titel (Value) mit einer ausserordentlichen Gewinn- und Kursentwicklung (Momentum) sowie niedrigen Risikokennzahlen und einer gesunden Bilanz- und Erfolgsrechnung (Quality). Das Zertifikat verwendet als Referenzindex den MSCI USA.

## Einteilung nach Sektoren

Neben Titeln aus dem MSCI USA Index besteht das Nachhaltigkeitsuniversum auch aus weiteren nachhaltigen Unternehmen aus den USA, die gewisse Mindestanforderungen an Marktkapitalisierung und Handelsvolumen erfüllen. Ausgangspunkt der Titelselektion bildet dabei zunächst die Einteilung aller als nachhaltig eingestufte Titel aus den USA nach Sektoren.

## Eckdaten ZKB Basket Sustainable

### USA

Valor	39 941 564
Bloomberg Symbol	USSUSZ

## Open End ZKB Tracker-Zertifikate

Valor	ISIN	Symbol	Tranche
39 941 564	CH0399415642	USSUSZ	Retail

## Kontakt

Sales Strukturierte Produkte  
Zürcher Kantonalbank  
Postfach, 8010 Zürich  
Telefon: +41 (0)44 293 66 65  
E-Mail: [derivate@zkb.ch](mailto:derivate@zkb.ch)

## ZKB Basket Sustainable USA Komponenten per 29.03.2024

Basiswert	Währung	Portfoliokategorie	Gewichtung per 29.03.2024
3M Co	USD	Industrie	2.06%
AbbVie Inc	USD	Gesundheitswesen	1.63%
Acuity Brands Inc	USD	Industrie	0.50%
Adobe Inc	USD	IT	2.64%
Alphabet Inc	USD	Telekommunikation	1.03%
Alphabet Inc	USD	Telekommunikation	2.66%
Amazon.com Inc	USD	Nicht-Basiskonsumgüter	5.23%
Amgen Inc	USD	Gesundheitswesen	0.42%
Apple Inc	USD	IT	3.42%
Applied Materials Inc	USD	IT	3.12%
Bank of America Corp	USD	Finanzwesen	1.00%
Bank of New York Mellon Corp/T	USD	Finanzwesen	2.71%
Bristol-Myers Squibb Co	USD	Gesundheitswesen	0.63%
Brixmor Property Group Inc	USD	Immobilien	0.75%
Cardinal Health Inc	USD	Gesundheitswesen	0.28%
Cisco Systems Inc	USD	IT	1.56%
CNO Financial Group Inc	USD	Finanzwesen	0.38%
Comcast Corp	USD	Telekommunikation	2.30%
CommVault Systems Inc	USD	IT	1.13%
Consolidated Edison Inc	USD	Versorgungsbetriebe	0.57%
Discover Financial Services	USD	Finanzwesen	0.52%
Dropbox Inc	USD	IT	1.85%
eBay Inc	USD	Nicht-Basiskonsumgüter	2.70%
Electronic Arts Inc	USD	Telekommunikation	0.74%
Eli Lilly & Co	USD	Gesundheitswesen	3.01%
Eventbrite Inc	USD	Telekommunikation	0.17%
Eversource Energy	USD	Versorgungsbetriebe	1.75%
Frontdoor Inc	USD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.48%
General Mills Inc	USD	Basiskonsumgüter	1.95%
Gentex Corp	USD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.53%
Gilead Sciences Inc	USD	Gesundheitswesen	0.98%
GMS Inc	USD	Industrie	0.48%
Grand Canyon Education Inc	USD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.49%
H&R Block Inc	USD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.26%
Innospec Inc	USD	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.63%
International Business Machine	USD	IT	1.13%
Ironwood Pharmaceuticals Inc	USD	Gesundheitswesen	1.11%
ITT Inc	USD	Industrie	2.20%
Jackson Financial Inc	USD	Finanzwesen	1.22%
Jones Lang LaSalle Inc	USD	Immobilien	0.28%
JPMorgan Chase & Co	USD	Finanzwesen	2.38%
Kimberly-Clark Corp	USD	Basiskonsumgüter	0.66%
Kimco Realty Corp	USD	Immobilien	0.67%
Koppers Holdings Inc	USD	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	1.60%
LiveRamp Holdings Inc	USD	IT	0.22%
Macerich Co/The	USD	Immobilien	0.90%
Masco Corp	USD	Industrie	1.83%
Medpace Holdings Inc	USD	Gesundheitswesen	0.61%
Merck & Co Inc	USD	Gesundheitswesen	2.18%
Microsoft Corp	USD	IT	6.43%
nVent Electric PLC	USD	Industrie	1.37%
NVIDIA Corp	USD	IT	4.94%
Owens Corning	USD	Industrie	0.33%
Primerica Inc	USD	Finanzwesen	1.00%

Basiswert	Währung	Portfolikategorie	Gewichtung per 29.03.2024
Procter & Gamble Co/The	USD	Basiskonsumgüter	3.46%
QUALCOMM Inc	USD	IT	0.66%
Ryman Hospitality Properties I	USD	Immobilien	0.25%
Salesforce Inc	USD	IT	2.87%
Selective Insurance Group Inc	USD	Finanzwesen	0.86%
ServiceNow Inc	USD	IT	0.91%
Solventum Corp	USD	Gesundheitswesen	0.31%
Sprouts Farmers Market Inc	USD	Basiskonsumgüter	0.70%
Teradata Corp	USD	IT	0.26%
Cigna Group/The	USD	Gesundheitswesen	0.23%
T-Mobile US Inc	USD	Telekommunikation	0.88%
TopBuild Corp	USD	Nicht-Basiskonsumgüter	1.49%
Vertex Pharmaceuticals Inc	USD	Gesundheitswesen	0.54%
Visa Inc	USD	Finanzwesen	2.04%
Voya Financial Inc	USD	Finanzwesen	1.17%
Watts Water Technologies Inc	USD	Industrie	0.22%
Yelp Inc	USD	Telekommunikation	1.54%

#### Disclaimer

Dieses Dokument dient ausschliesslich zu Informationszwecken. Alle Informationen und Daten in diesem Dokument stammen aus Quellen, welche die Zürcher Kantonalbank zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Dokuments für zuverlässig hält. Alle Berechnungen und Aussagen wurden mit grösster Sorgfalt erstellt. Trotzdem kann keine Gewähr für deren Richtigkeit, Genauigkeit, Vollständigkeit und Angemessenheit übernommen werden - weder ausdrücklich noch stillschweigend. Dieses Dokument stellt weder ein Angebot zum Kauf oder Verkauf irgendeines Wertpapiers dar, noch enthält es die Grundlage für einen Vertrag oder eine Verpflichtung irgendeiner Art. Jedes Investment, z.B. in Anleihen, Aktien, Optionen und Derivate, ist mit Risiken behaftet. Eine Investitionsentscheidung hinsichtlich irgendeines Wertpapiers darf nicht auf der Grundlage dieses Dokuments erfolgen. Die Zürcher Kantonalbank ist nicht verantwortlich für Konsequenzen, speziell für Verluste, welche durch die Verwendung oder die Unterlassung der Verwendung aus den in diesem Dokument enthaltenen Ansichten und Rückschlüsse folgen bzw. folgen könnten. Zurückliegende Wert-, Preis- oder Kursentwicklungen geben keine Anhaltspunkte auf die zukünftige Entwicklung des Investments. Die Zürcher Kantonalbank übernimmt keine Garantie dafür, dass die angedeutete Performance oder die genannte Kursentwicklung erreicht werden.

Für Verkauf und Angebot von strukturierten Produkten können länderspezifische Restriktionen bestehen, welche zwingend einzuhalten sind. Für die erwähnten strukturierten Produkte und das vorliegende Dokument sind insbesondere die Restriktionen in U.K., Guernsey, EWR-Staaten, USA und für U.S. Personen einzuhalten. Insbesondere darf dieses Dokument und die darin enthaltenen Informationen nicht an Personen, die möglicherweise US-Personen nach der Definition der Regulation S des US Securities Act von 1933 sind, verteilt und/oder weiterverteilt werden. Definitionsgemäss umfasst «US Person» jede natürliche US-Person oder juristische Person, jedes Unternehmen, jede Firma, Kollektivgesellschaft oder sonstige Gesellschaft, die nach amerikanischem Recht gegründet wurde. Im Weiteren gelten die Kategorien der Regulation S. Die Anleger werden darauf hingewiesen, dass Telefonate mit Handels- und Verkaufseinheiten der Zürcher Kantonalbank aufgezeichnet werden. Anleger, die Telefonsprache mit diesen Einheiten führen, stimmen der Aufzeichnung stillschweigend zu.