

# ZKB Basket Sustainable Japan

Reporting | Valor 25 347 217

31.10.2024

**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

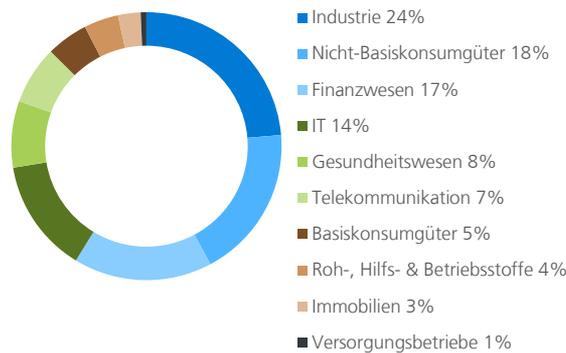
■ Systematische Titelauswahl aus dem nachhaltigen Anlageuniversum der Zürcher Kantonalbank

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

Aufteilung nach Region per 31.10.2024



Aufteilung nach Portfoliokategorie per 31.10.2024



## Performancekennzahlen ZKB Basket Sustainable Japan

| Absolut         | Annualisiert |
|-----------------|--------------|
| 1Mt             | -1.9%        |
| 3Mte            | -6.2%        |
| 1J              | 16.5%        |
| 3J              | -3.8%        |
| 5J              | 5.7%         |
| seit Lancierung | 25.9%        |

| Jahresperformance | Anteil |
|-------------------|--------|
| 2016              | 3.6%   |
| 2017              | 19.3%  |
| 2018              | -13.0% |
| 2019              | 16.8%  |
| 2020              | 3.8%   |
| 2021              | 5.8%   |
| 2022              | -17.4% |
| 2023              | 2.9%   |
| 2024 YTD          | 13.1%  |

## Beschreibung

Das Zertifikat investiert in Beteiligungspapiere von Gesellschaften, die ihr Domizil oder die überwiegende Geschäftstätigkeit in Japan 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 Japan, 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 Japan.

## Einteilung nach Sektoren

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

## Eckdaten ZKB Basket Sustainable

### Japan

|                  |            |
|------------------|------------|
| Valor            | 25 347 217 |
| Bloomberg Symbol | ZKJANA     |

## Open End ZKB Tracker-Zertifikate

| Valor      | ISIN         | Symbol | Tranche |
|------------|--------------|--------|---------|
| 25 347 217 | CH0253472176 | ZKJANA | 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 Japan Komponenten per 31.10.2024

| Basiswert                      | Währung | Portfoliokategorie            | Gewichtung per 31.10.2024 |
|--------------------------------|---------|-------------------------------|---------------------------|
| Aeon Mall Co Ltd               | JPY     | Immobilien                    | 0.31%                     |
| Aisin Corp                     | JPY     | Nicht-Basiskonsumgüter        | 2.37%                     |
| Amada Co Ltd                   | JPY     | Industrie                     | 1.98%                     |
| Asics Corp                     | JPY     | Nicht-Basiskonsumgüter        | 1.70%                     |
| Central Japan Railway Co       | JPY     | Industrie                     | 0.60%                     |
| Citizen Watch Co Ltd           | JPY     | IT                            | 0.11%                     |
| Daicel Corp                    | JPY     | Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe | 0.62%                     |
| Dai-ichi Life Holdings Inc     | JPY     | Finanzwesen                   | 1.65%                     |
| Daiichi Sankyo Co Ltd          | JPY     | Gesundheitswesen              | 0.36%                     |
| Daiwa House REIT Investment Co | JPY     | Immobilien                    | 0.65%                     |
| Denso Corp                     | JPY     | Nicht-Basiskonsumgüter        | 1.23%                     |
| Dentsu Group Inc               | JPY     | Telekommunikation             | 0.45%                     |
| Dexerials Corp                 | JPY     | IT                            | 0.86%                     |
| DIC Corp                       | JPY     | Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe | 0.30%                     |
| Fancl Corp                     | JPY     | Basiskonsumgüter              | 0.42%                     |
| FANUC Corp                     | JPY     | Industrie                     | 2.82%                     |
| Fast Retailing Co Ltd          | JPY     | Nicht-Basiskonsumgüter        | 1.02%                     |
| FUJIFILM Holdings Corp         | JPY     | IT                            | 0.49%                     |
| Fujikura Ltd                   | JPY     | Industrie                     | 0.51%                     |
| Hitachi Construction Machinery | JPY     | Industrie                     | 1.73%                     |
| Horiba Ltd                     | JPY     | IT                            | 0.81%                     |
| Hoya Corp                      | JPY     | Gesundheitswesen              | 1.67%                     |
| Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd | JPY     | Nicht-Basiskonsumgüter        | 1.03%                     |
| J Front Retailing Co Ltd       | JPY     | Nicht-Basiskonsumgüter        | 1.33%                     |
| Kanematsu Corp                 | JPY     | Industrie                     | 1.68%                     |
| Kitz Corp                      | JPY     | Industrie                     | 0.30%                     |
| Kubota Corp                    | JPY     | Industrie                     | 1.41%                     |
| Kuraray Co Ltd                 | JPY     | Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe | 1.16%                     |
| Lintec Corp                    | JPY     | Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe | 0.15%                     |
| LITALICO Inc                   | JPY     | Nicht-Basiskonsumgüter        | 0.09%                     |
| Mabuchi Motor Co Ltd           | JPY     | Industrie                     | 0.54%                     |
| MatsukiyoCocokara & Co         | JPY     | Basiskonsumgüter              | 0.46%                     |
| Meidensha Corp                 | JPY     | Industrie                     | 0.29%                     |
| Mitsubishi Estate Co Ltd       | JPY     | Immobilien                    | 0.21%                     |
| Mitsubishi UFJ Financial Group | JPY     | Finanzwesen                   | 0.54%                     |
| Mizuho Financial Group Inc     | JPY     | Finanzwesen                   | 3.13%                     |
| Mizuno Corp                    | JPY     | Nicht-Basiskonsumgüter        | 0.12%                     |
| MS&AD Insurance Group Holdings | JPY     | Finanzwesen                   | 0.39%                     |
| NEC Corp                       | JPY     | IT                            | 2.66%                     |
| NGK Insulators Ltd             | JPY     | Industrie                     | 0.90%                     |
| Nifco Inc/Japan                | JPY     | Nicht-Basiskonsumgüter        | 1.38%                     |
| Nintendo Co Ltd                | JPY     | Telekommunikation             | 2.70%                     |
| Nisshin Seifun Group Inc       | JPY     | Basiskonsumgüter              | 2.22%                     |
| Nomura Holdings Inc            | JPY     | Finanzwesen                   | 1.47%                     |
| Nomura Real Estate Holdings In | JPY     | Immobilien                    | 1.55%                     |
| Nomura Research Institute Ltd  | JPY     | IT                            | 0.45%                     |
| NSK Ltd                        | JPY     | Industrie                     | 0.29%                     |
| NTN Corp                       | JPY     | Industrie                     | 0.67%                     |
| Olympus Corp                   | JPY     | Gesundheitswesen              | 1.30%                     |
| Ono Pharmaceutical Co Ltd      | JPY     | Gesundheitswesen              | 0.98%                     |
| Otsuka Holdings Co Ltd         | JPY     | Gesundheitswesen              | 1.24%                     |
| Recruit Holdings Co Ltd        | JPY     | Industrie                     | 5.13%                     |
| Renesas Electronics Corp       | JPY     | IT                            | 1.84%                     |
| RENOVA Inc                     | JPY     | Versorgungsbetriebe           | 0.68%                     |

| Basiswert                      | Währung | Portfoliokategorie            | Gewichtung per 31.10.2024 |
|--------------------------------|---------|-------------------------------|---------------------------|
| Santen Pharmaceutical Co Ltd   | JPY     | Gesundheitswesen              | 0.69%                     |
| Sanwa Holdings Corp            | JPY     | Industrie                     | 3.20%                     |
| Sato Holdings Corp             | JPY     | Industrie                     | 0.31%                     |
| Shimano Inc                    | JPY     | Nicht-Basiskonsumgüter        | 0.14%                     |
| Shin-Etsu Chemical Co Ltd      | JPY     | Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe | 1.09%                     |
| Shionogi & Co Ltd              | JPY     | Gesundheitswesen              | 1.35%                     |
| SoftBank Corp                  | JPY     | Telekommunikation             | 3.36%                     |
| SoftBank Group Corp            | JPY     | Telekommunikation             | 0.52%                     |
| Sompo Holdings Inc             | JPY     | Finanzwesen                   | 3.53%                     |
| Sony Group Corp                | JPY     | Nicht-Basiskonsumgüter        | 2.94%                     |
| Sumitomo Bakelite Co Ltd       | JPY     | Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe | 0.81%                     |
| Sumitomo Electric Industries L | JPY     | Nicht-Basiskonsumgüter        | 2.24%                     |
| Sumitomo Mitsui Financial Grou | JPY     | Finanzwesen                   | 5.12%                     |
| Takeda Pharmaceutical Co Ltd   | JPY     | Gesundheitswesen              | 0.43%                     |
| TDK Corp                       | JPY     | IT                            | 1.32%                     |
| Tokio Marine Holdings Inc      | JPY     | Finanzwesen                   | 0.75%                     |
| Tokyo Electron Ltd             | JPY     | IT                            | 3.33%                     |
| Tomy Co Ltd                    | JPY     | Nicht-Basiskonsumgüter        | 2.08%                     |
| TOPPAN Holdings Inc            | JPY     | Industrie                     | 1.31%                     |
| Trend Micro Inc/Japan          | JPY     | IT                            | 0.57%                     |
| Unicharm Corp                  | JPY     | Basiskonsumgüter              | 0.71%                     |
| USS Co Ltd                     | JPY     | Nicht-Basiskonsumgüter        | 0.79%                     |
| Valor Holdings Co Ltd          | JPY     | Basiskonsumgüter              | 1.20%                     |
| Yokogawa Electric Corp         | JPY     | IT                            | 1.24%                     |

#### 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.