

ZKB Basket Sustainable Japan

Reporting | Valor 25 347 217

31.12.2021

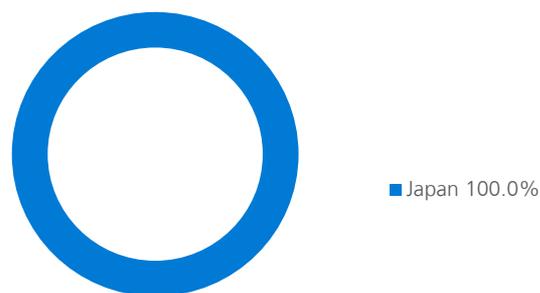
Hierbei handelt es sich in der Schweiz um Strukturierte Produkte. Sie sind keine kollektiven Kapitalanlagen im Sinne des Kollektivanlagegesetzes (KAG). Sie unterstehen weder der Genehmigungspflicht noch der Aufsicht der FINMA und Anleger geniessen nicht den spezifischen Anlegerschutz des KAG.

In Kürze

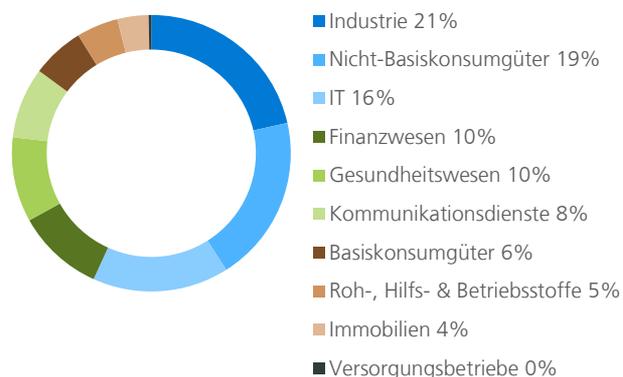
■ Systematische Titelauswahl aus dem nachhaltigen Anlageuniversum der Zürcher Kantonalbank

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

Aufteilung nach Region per 31.12.2021



Aufteilung nach Portfoliokategorie per 31.12.2021



Performancekennzahlen ZKB Basket Sustainable Japan

Absolut	Annualisiert	
1Mt	1.7%	
3Mte	-4.6%	
1J	5.8%	
3J	28.2%	9.4%
5J	33.2%	6.6%
seit Lancierung	30.9%	5.1%

Jahresperformance	
2013	
2014	
2015	
2016	3.6%
2017	19.3%
2018	-13.0%
2019	16.8%
2020	3.8%

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

ZKB Basket Sustainable Japan Komponenten per 31.12.2021

Basiswert	Währung	Portfoliokategorie	Gewichtung per 31.12.2021
Asahi Kasei Corp	JPY	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.77%
Astellas Pharma Inc	JPY	Gesundheitswesen	3.16%
Bridgestone Corp	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	3.19%
Canon Inc	JPY	IT	1.84%
Daiichi Sankyo Co Ltd	JPY	Gesundheitswesen	1.23%
Daiwa House Industry Co Ltd	JPY	Immobilien	0.23%
DIC Corp	JPY	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	1.16%
Ebara Corp	JPY	Industrie	0.26%
Global One Real Estate Investm	JPY	Immobilien	0.86%
Hoya Corp	JPY	Gesundheitswesen	1.04%
KDDI Corp	JPY	Kommunikationsdienste	3.11%
Kubota Corp	JPY	Industrie	1.58%
Kurita Water Industries Ltd	JPY	Industrie	0.83%
Kyowa Kirin Co Ltd	JPY	Gesundheitswesen	1.12%
Life Corp	JPY	Basiskonsumgüter	0.18%
Lixil Corp	JPY	Industrie	2.44%
MINEBEA MITSUMI Inc	JPY	Industrie	1.16%
Mizuho Financial Group Inc	JPY	Finanzwesen	3.29%
Nabtesco Corp	JPY	Industrie	0.32%
NEC Corp	JPY	IT	0.99%
NGK Insulators Ltd	JPY	Industrie	2.57%
Nidec Corp	JPY	Industrie	0.96%
Nippon Telegraph & Telephone C	JPY	Kommunikationsdienste	2.65%
Nitto Denko Corp	JPY	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	2.91%
Nomura Holdings Inc	JPY	Finanzwesen	1.35%
Nomura Real Estate Holdings In	JPY	Immobilien	2.52%
Nomura Research Institute Ltd	JPY	IT	1.00%
Obayashi Corp	JPY	Industrie	0.82%
Olympus Corp	JPY	Gesundheitswesen	0.48%
Omron Corp	JPY	IT	1.34%
Ono Pharmaceutical Co Ltd	JPY	Gesundheitswesen	1.03%
ORIX Corp	JPY	Finanzwesen	1.10%
Panasonic Corp	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	3.12%
Recruit Holdings Co Ltd	JPY	Industrie	4.33%
Ricoh Co Ltd	JPY	IT	2.20%
Rinnai Corp	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	1.44%
Secom Co Ltd	JPY	Industrie	2.85%
Sekisui House Ltd	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	2.26%
Shimano Inc	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	1.83%
Shiseido Co Ltd	JPY	Basiskonsumgüter	1.44%
SMC Corp	JPY	Industrie	3.17%
SoftBank Corp	JPY	Kommunikationsdienste	2.53%
Sompo Holdings Inc	JPY	Finanzwesen	1.89%
Sony Group Corp	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	5.09%
Sumitomo Electric Industries L	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	0.67%
Sumitomo Mitsui Financial Grou	JPY	Finanzwesen	1.31%
Takeda Pharmaceutical Co Ltd	JPY	Gesundheitswesen	1.85%
Tokio Marine Holdings Inc	JPY	Finanzwesen	1.21%
Tokyo Electron Ltd	JPY	IT	4.74%
Trend Micro Inc/Japan	JPY	IT	2.11%
Unicharm Corp	JPY	Basiskonsumgüter	2.95%
Welcia Holdings Co Ltd	JPY	Basiskonsumgüter	1.04%
West Holdings Corp	JPY	Versorgungsbetriebe	0.31%
Yamada Holdings Co Ltd	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	1.72%

Basiswert	Wahrung	Portfoliokategorie	Gewichtung per 31.12.2021
Yamaha Corp	JPY	Nicht-Basiskonsumguter	0.17%
YA-MAN Ltd	JPY	Basiskonsumguter	0.49%
Yaskawa Electric Corp	JPY	Industrie	0.17%
Yokogawa Electric Corp	JPY	IT	1.60%

Disclaimer

Dieses Dokument dient ausschliesslich zu Informationszwecken. Alle Informationen und Daten in diesem Dokument stammen aus Quellen, welche die Zurcher Kantonalbank zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Dokuments fur zuverlassig halt. Alle Berechnungen und Aussagen wurden mit grosster Sorgfalt erstellt. Trotzdem kann keine Gewahr fur deren Richtigkeit, Genauigkeit, Vollstandigkeit und Angemessenheit ubernommen werden - weder ausdrucklich noch stillschweigend. Dieses Dokument stellt weder ein Angebot zum Kauf oder Verkauf irgendeines Wertpapiers dar, noch enthalt es die Grundlage fur 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 Zurcher Kantonalbank ist nicht verantwortlich fur Konsequenzen, speziell fur Verluste, welche durch die Verwendung oder die Unterlassung der Verwendung aus den in diesem Dokument enthaltenen Ansichten und Ruckschlusse folgen bzw. folgen konnten. Zururckliegende Wert-, Preis- oder Kursentwicklungen geben keine Anhaltspunkte auf die zukunftige Entwicklung des Investments. Die Zurcher Kantonalbank ubernimmt keine Garantie dafur, dass die angedeutete Performance oder die genannte Kursentwicklung erreicht werden. Fur Verkauf und Angebot von strukturierten Produkten konnen landerspezifische Restriktionen bestehen, welche zwingend einzuhalten sind. Fur die erwahnten strukturierten Produkte und das vorliegende Dokument sind insbesondere die Restriktionen in U.K., Guernsey, EWR-Staaten, USA und fur U.S. Personen einzuhalten. Insbesondere darf dieses Dokument und die darin enthaltenen Informationen nicht an Personen, die moglicherweise US-Personen nach der Definition der Regulation S des US Securities Act von 1933 sind, verteilt und/oder weiterverteilt werden. Definitionsgemass umfasst «US Person» jede naturliche US-Person oder juristische Person, jedes Unternehmen, jede Firma, Kollektivgesellschaft oder sonstige Gesellschaft, die nach amerikanischem Recht gegrundet wurde. Im Weiteren gelten die Kategorien der Regulation S. Die Anleger werden darauf hingewiesen, dass Telefonate mit Handels- und Verkaufseinheiten der Zurcher Kantonalbank aufgezeichnet werden. Anleger, die Telefongesprache mit diesen Einheiten fuhren, stimmen der Aufzeichnung stillschweigend zu.