

ZKB Basket Sustainable Japan

Reporting | Valor 25 347 217

29.03.2024

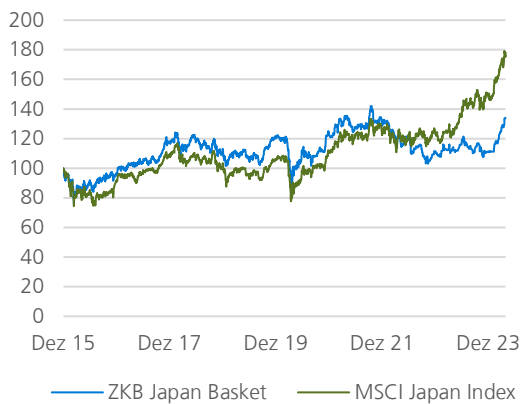
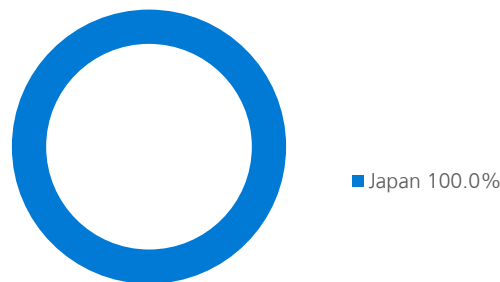
Hierbei handelt es sich in der Schweiz um Strukturierte Produkte. Sie sind keine kollektiven Kapitalanlagen im Sinne des Kollektivanlagegesetzes (KAG). Sie unterstehen weder der Genehmigungspflicht noch der Aufsicht der FINMA und Anleger geniessen nicht den spezifischen Anlegerschutz des KAG.

In Kürze

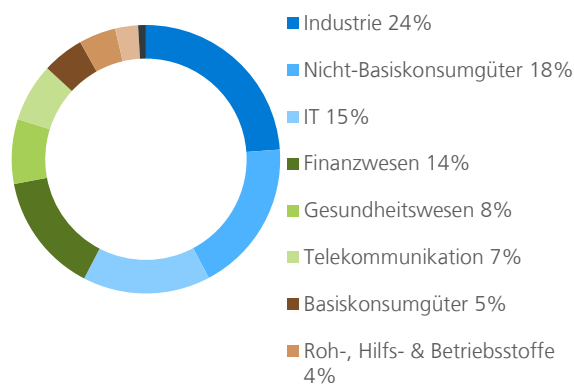
■ Systematische Titelauswahl aus dem nachhaltigen Anlageuniversum der Zürcher Kantonalbank

■ 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 Japan

Absolut	Annualisiert	
1Mt	6.9%	
3Mte	20.6%	
1J	18.5%	
3J	-0.7%	-0.2%
5J	23.4%	4.7%
seit Lancierung	34.1%	4.1%

Jahresperformance	
2015	
2016	3.6%
2017	19.3%
2018	-13.0%
2019	16.8%
2020	3.8%
2021	5.8%
2022	-17.4%
2023	2.9%

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 29.03.2024

Basiswert	Währung	Portfoliokategorie	Gewichtung per 29.03.2024
Advantest Corp	JPY	IT	1.71%
Aisin Corp	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	2.60%
Asics Corp	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	0.46%
Astellas Pharma Inc	JPY	Gesundheitswesen	2.10%
Bridgestone Corp	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	3.05%
Central Japan Railway Co	JPY	Industrie	0.52%
Dai-ichi Life Holdings Inc	JPY	Finanzwesen	1.08%
Daiichi Sankyo Co Ltd	JPY	Gesundheitswesen	0.42%
Daiwa House Industry Co Ltd	JPY	Immobilien	0.30%
Dentsu Group Inc	JPY	Telekommunikation	0.60%
Dexerials Corp	JPY	IT	1.35%
Ebara Corp	JPY	Industrie	0.40%
eRex Co Ltd	JPY	Versorgungsbetriebe	0.93%
Exedy Corp	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	0.91%
FANUC Corp	JPY	Industrie	2.98%
Fast Retailing Co Ltd	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	0.90%
FUJIFILM Holdings Corp	JPY	IT	3.18%
Fujikura Ltd	JPY	Industrie	3.24%
Fuyo General Lease Co Ltd	JPY	Finanzwesen	0.29%
Hitachi Construction Machinery	JPY	Industrie	1.61%
Hoya Corp	JPY	Gesundheitswesen	2.79%
Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	1.23%
Kitz Corp	JPY	Industrie	0.30%
Kubota Corp	JPY	Industrie	1.61%
Kuraray Co Ltd	JPY	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	1.08%
Lawson Inc	JPY	Basiskonsumgüter	1.82%
LY Corp	JPY	Telekommunikation	0.54%
Meidensha Corp	JPY	Industrie	2.53%
Mitsubishi UFJ Financial Group	JPY	Finanzwesen	0.43%
Mitsui Fudosan Co Ltd	JPY	Immobilien	0.75%
Miura Co Ltd	JPY	Industrie	0.40%
Mizuho Financial Group Inc	JPY	Finanzwesen	2.61%
NEC Corp	JPY	IT	1.10%
NGK Insulators Ltd	JPY	Industrie	0.93%
Nintendo Co Ltd	JPY	Telekommunikation	2.70%
Nisshin Seifun Group Inc	JPY	Basiskonsumgüter	0.21%
Nitto Denko Corp	JPY	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	1.29%
Nomura Holdings Inc	JPY	Finanzwesen	0.96%
Nomura Real Estate Holdings In	JPY	Immobilien	1.45%
NSK Ltd	JPY	Industrie	0.34%
NTN Corp	JPY	Industrie	0.81%
Odakyu Electric Railway Co Ltd	JPY	Industrie	0.24%
Okamura Corp	JPY	Industrie	0.39%
ORIX Corp	JPY	Finanzwesen	0.90%
Otsuka Holdings Co Ltd	JPY	Gesundheitswesen	0.87%
Recruit Holdings Co Ltd	JPY	Industrie	2.27%
Renesas Electronics Corp	JPY	IT	0.87%
Sanken Electric Co Ltd	JPY	IT	0.42%
Sanwa Holdings Corp	JPY	Industrie	2.11%
Sato Holdings Corp	JPY	Industrie	0.27%
SCREEN Holdings Co Ltd	JPY	IT	0.76%
Secom Co Ltd	JPY	Industrie	0.69%
Sekisui House Ltd	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	1.03%
Shin-Etsu Chemical Co Ltd	JPY	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	1.24%

Basiswert	Währung	Portfoliokategorie	Gewichtung per 29.03.2024
Shionogi & Co Ltd	JPY	Gesundheitswesen	0.34%
SoftBank Corp	JPY	Telekommunikation	1.48%
SoftBank Group Corp	JPY	Telekommunikation	1.72%
Sompo Holdings Inc	JPY	Finanzwesen	3.13%
Sony Group Corp	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	1.65%
Sumitomo Bakelite Co Ltd	JPY	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.83%
Sumitomo Electric Industries L	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	0.48%
Sumitomo Mitsui Financial Grou	JPY	Finanzwesen	5.03%
Sumitomo Rubber Industries Ltd	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	1.65%
Takeda Pharmaceutical Co Ltd	JPY	Gesundheitswesen	1.26%
Takuma Co Ltd	JPY	Industrie	0.21%
Tokyo Electron Ltd	JPY	IT	5.30%
Tokyu Fudosan Holdings Corp	JPY	Immobilien	0.27%
Tomy Co Ltd	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	1.47%
TOPPAN Holdings Inc	JPY	Industrie	1.99%
Toyoda Gosei Co Ltd	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	2.33%
Trend Micro Inc/Japan	JPY	IT	0.40%
Unicharm Corp	JPY	Basiskonsumgüter	0.87%
Valor Holdings Co Ltd	JPY	Basiskonsumgüter	2.11%
WingArc1st Inc	JPY	IT	0.28%
Yokohama Rubber Co Ltd/The	JPY	Nicht-Basiskonsumgüter	0.65%

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 angegedutete 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 Telefonesprache mit diesen Einheiten führen, stimmen der Aufzeichnung stillschweigend zu.