ZKB MeinIndex Sustainable Emerging Markets

Reporting | Valor 13 599 733 28.04.2023

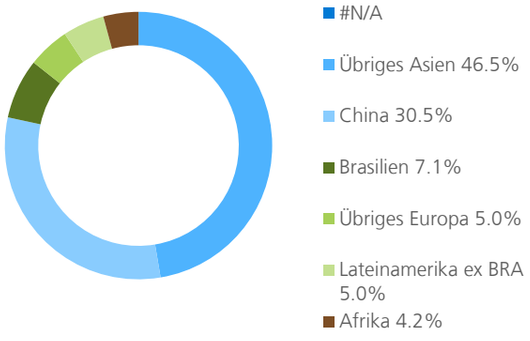
Hierbei handelt es sich in der Schweiz um Strukturierte Produkte. Sie sind keine kollektiven Kapitalanlagen im Sinne des Kollektivanlagegesetzes (KAG). Sie unterstehen weder der Genehmigungspflicht noch der Aufsicht der FINMA und Anleger geniessen nicht den spezifischen Anlegerschutz des KAG.

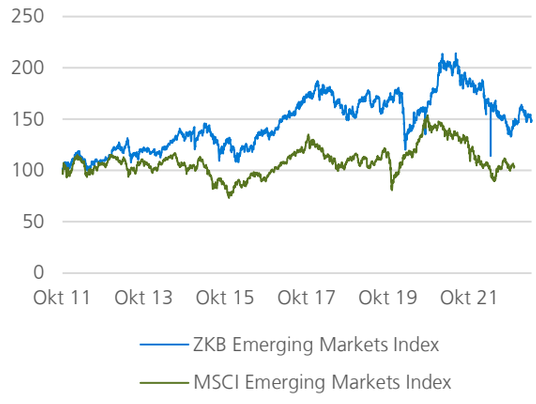
In Kürze

■ Systematische Titelauswahl aus dem nachhaltigen Anlageuniversum der Zürcher Kantonalbank

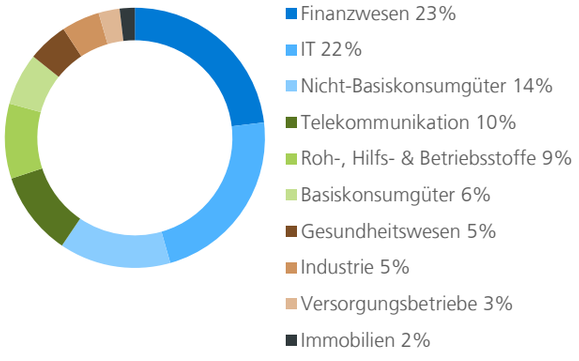
■Investition sowohl in Branchenleader punkto Nachhaltigkeit als auch in kleinere Unternehmen mit innovativen, nachhaltigen Produkten (Innovatoren)

Aufteilung nach Region per 28.04.2023





Aufteilung nach Portfoliokategorie per 28.04.2023



Performancekennzahlen ZKB MeinIndex Sustainable Emerging Markets

Absolut		Annualisiert
1Mt	-3.9%	
3Mte	-7.1%	
1J	-9.7%	
3J	3.1%	1.0%
5J	-17.5%	-3.5%
seit Lancierung	49.0%	4.2%

Jahresperformance	
2013	2.6%
2014	16.4%
2015	-11.0%
2016	11.1%
2017	30.9%
2018	-14.7%
2019	16.2%
2020	2.7%

Steigende Umwelt- und Sozialrisiken
Gemessen an deren Anteil am globalen Bruttoinlandsprodukt (BIP) und an der Kapitalisierung nimmt die Bedeutung der Schwellenländer stetig zu. Langfristprognosen gehen davon aus, dass bis 2050 die sieben grössten Schwellenländer (E7) gemeinsam ein doppelt so hohes BIP wie die G7-Industriestaaten ausweisen werden. Mit den hohen Wachstumserwartungen steigen jedoch auch die damit verbundenen Umwelt- und Sozialrisiken. Zwar vermindert sich einerseits durch das rasante Wachstum in Schwellenländern die Kluft zwischen armen und reichen Ländern, was das globale Wohlstandsniveau ansteigen lässt. Andererseits machen sich zusehends Schattenseiten dieser Entwicklung bemerkbar, indem eine immer rasantere Steigerung des Ressourcenverbrauchs resultiert und ein zunehmender Ausstoss von Treibhausgasen, was den Klimawandel weiter beschleunigen wird. Zudem werden die Schwellenländer unter anderem mangels ausreichender Sozialsysteme ein hohes Bevölkerungswachstum beibehalten (global ist bis 2050 mit neun Milliarden Menschen zu rechnen).

Mehrwert schaffen durch nachhaltige Unternehmen
Um den oben beschriebenen problematischen Effekten entgegenzuwirken, ist es zentral, dass gerade Unternehmen in Schwellenländern proaktiv, zum Beispiel durch effizientere und nachhaltigere Produktionsweisen, eine Entkoppelung von Ressourcenverbrauch und Wachstum anstreben und damit auch über zusätzliche Wettbewerbsvorteile verfügen. Alle Unternehmen, die sich für den ZKB MeinIndex Nachhaltigkeit Emerging Markets qualifizieren, werden einer eingehenden Nachhaltigkeitsprüfung durch das ZKB Nachhaltigkeitsresearch unterzogen.

Kombination von Nachhaltigkeit, Value, Momentum und Quality
Auf Basis des proprietären nachhaltigen Universums 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).

Einteilung nach Sektoren
Neben ausgesuchten Titeln aus dem MSCI Emerging Markets Index (ex Energy, ex Mining) besteht das Nachhaltigkeitsuniversum auch aus weiteren nachhaltigen Unternehmen aus der Emerging Markets-Region, die gewisse Mindestanforderungen an Marktkapitalisierung und Handelsvolumen erfüllen. Ausgangspunkt der Titelselektion bildet dabei zunächst die Einteilung aller als nachhaltig eingestufter Titel aus dem pazifischen Raum nach Sektoren. Durch den Nachhaltigkeitsfilter sind sämtliche Energie- und Miningunternehmen ausgeschlossen.

Eckdaten ZKB MeinIndex Sustainable Emerging Markets

Valor	13 599 733
Bloomberg Symbol	ZKBIEMMA

Open End ZKB Tracker-Zertifikate

Valor	ISIN	Symbol	Tranche
10 716 476	CH0107164763	TREMMO	Retail
10 716 477	CH0107164771	TREMMI	Institutionell

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

ZKB MeinIndex Sustainable Emerging Markets Komponenten per 28.04.2023

Basiswert	Währung	Portfoliokategorie	Gewichtung per 28.04.2023
AAC Technologies Holdings Inc	HKD	IT	0.26%
Alibaba Group Holding Ltd	HKD	Nicht-Basiskonsumgüter	3.88%
Alpha Services and Holdings SA	EUR	Finanzwesen	0.93%
America Movil SAB de CV	MXN	Telekommunikation	0.91%
AMMB Holdings Bhd	MYR	Finanzwesen	0.78%
ASE Technology Holding Co Ltd	TWD	IT	0.35%
Aspen Pharmacare Holdings Ltd	ZAr	Gesundheitswesen	0.24%
Baidu Inc	HKD	Telekommunikation	0.75%
Fibra Uno Administracion SA de	MXN	Immobilien	0.39%
Banco Bradesco SA	BRL	Finanzwesen	0.89%
Banco do Brasil SA	BRL	Finanzwesen	0.84%
Bosideng International Holding	HKD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.63%
Bumrungrad Hospital PCL	THB	Gesundheitswesen	0.62%
Catcher Technology Co Ltd	TWD	IT	0.48%
China CITIC Bank Corp Ltd	HKD	Finanzwesen	1.50%
China Communications Services	HKD	Industrie	0.29%
China Construction Bank Corp	HKD	Finanzwesen	3.98%
China Everbright Environment G	HKD	Industrie	0.28%
China Feihe Ltd	HKD	Basiskonsumgüter	0.46%
China Medical System Holdings	HKD	Gesundheitswesen	0.45%
China Meidong Auto Holdings Lt	HKD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.25%
China Overseas Land & Investme	HKD	Immobilien	0.24%
China Resources Gas Group Ltd	HKD	Versorgungsbetriebe	0.77%
China Taiping Insurance Holdin	HKD	Finanzwesen	0.47%
Chinasoft International Ltd	HKD	IT	0.24%
CIMB Group Holdings Bhd	MYR	Finanzwesen	1.21%
Clicks Group Ltd	ZAr	Basiskonsumgüter	0.33%
Cia de Saneamento Basico do Es	BRL	Versorgungsbetriebe	0.67%
Cia Energetica de Minas Gerais	BRL	Versorgungsbetriebe	0.85%
Coway Co Ltd	KRW	Nicht-Basiskonsumgüter	0.86%
CPFL Energia SA	BRL	Versorgungsbetriebe	0.32%
Credicorp Ltd	USD	Finanzwesen	0.62%
CRRC Corp Ltd	HKD	Industrie	0.79%
CSPC Pharmaceutical Group Ltd	HKD	Gesundheitswesen	0.50%
Cyfrowy Polsat SA	PLN	Telekommunikation	0.51%
DB Insurance Co Ltd	KRW	Finanzwesen	0.27%
Delta Electronics Inc	TWD	IT	0.99%
Far East Horizon Ltd	HKD	Finanzwesen	0.31%
Far Eastern New Century Corp	TWD	Industrie	0.73%
FirstRand Ltd	ZAr	Finanzwesen	0.60%
Formosa Chemicals & Fibre Corp	TWD	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.30%
Ganfeng Lithium Group Co Ltd	HKD	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.41%
Haier Smart Home Co Ltd	HKD	Nicht-Basiskonsumgüter	1.08%
Haitian International Holdings	HKD	Industrie	0.62%
Hankook Tire & Technology Co L	KRW	Nicht-Basiskonsumgüter	0.48%
Hanmi Pharm Co Ltd	KRW	Gesundheitswesen	0.34%
Hansoh Pharmaceutical Group Co	HKD	Gesundheitswesen	0.35%
Hanwha Galleria Co Ltd	KRW	Nicht-Basiskonsumgüter	0.01%
Hanwha Solutions Corp	KRW	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.33%
Hellenic Telecommunications Or	EUR	Telekommunikation	0.32%
Home Product Center PCL	THB	Nicht-Basiskonsumgüter	0.28%
Hua Hong Semiconductor Ltd	HKD	IT	0.25%
Hypera SA	BRL	Gesundheitswesen	0.54%
IHH Healthcare Bhd	MYR	Gesundheitswesen	0.24%

Basiswert	Währung	Portfoliokategorie	Gewichtung per 28.04.2023
Indorama Ventures PCL	THB	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	2.24%
International Container Termin	PHP	Industrie	0.82%
JD.com Inc	HKD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.73%
KB Financial Group Inc	KRW	Finanzwesen	0.72%
Kimberly-Clark de Mexico SAB d	MXN	Basiskonsumgüter	1.19%
Klabin SA	BRL	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	1.82%
Komercni Banka AS	CZK	Finanzwesen	0.58%
Krung Thai Bank PCL	THB	Finanzwesen	0.32%
Kumho Petrochemical Co Ltd	KRW	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.50%
Largan Precision Co Ltd	TWD	IT	0.39%
Lenovo Group Ltd	HKD	IT	0.70%
LG Chem Ltd	KRW	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	1.42%
LG Electronics Inc	KRW	Nicht-Basiskonsumgüter	0.62%
LG Uplus Corp	KRW	Telekommunikation	0.36%
Lite-On Technology Corp	TWD	IT	1.15%
MediaTek Inc	TWD	IT	0.64%
Meituan	HKD	Nicht-Basiskonsumgüter	1.21%
Metropolitan Bank & Trust Co	PHP	Finanzwesen	0.82%
Minth Group Ltd	HKD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.59%
MR DIY Group M Bhd	MYR	Nicht-Basiskonsumgüter	0.29%
MTN Group Ltd	ZAr	Telekommunikation	1.22%
Naspers Ltd	ZAr	Nicht-Basiskonsumgüter	0.76%
National Bank of Greece SA	EUR	Finanzwesen	0.28%
Nedbank Group Ltd	ZAr	Finanzwesen	0.51%
NEPI Rockcastle NV	ZAr	Immobilien	0.79%
NetEase Inc	HKD	Telekommunikation	0.83%
Nien Made Enterprise Co Ltd	TWD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.40%
Nongfu Spring Co Ltd	HKD	Basiskonsumgüter	0.72%
Novatek Microelectronics Corp	TWD	IT	0.21%
Orbia Advance Corp SAB de CV	MXN	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	1.84%
OTP Bank Nyrt	HUF	Finanzwesen	1.21%
Ping An Insurance Group Co of	HKD	Finanzwesen	1.00%
POSCO Future M Co Ltd	KRW	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.42%
Postal Savings Bank of China C	HKD	Finanzwesen	0.57%
Pou Chen Corp	TWD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.66%
Powszechny Zaklad Ubezpieczen	PLN	Finanzwesen	1.26%
Bank Mandiri Persero Tbk PT	IDR	Finanzwesen	1.05%
Bank Negara Indonesia Persero	IDR	Finanzwesen	0.99%
Kalbe Farma Tbk PT	IDR	Gesundheitswesen	0.42%
Telkom Indonesia Persero Tbk P	IDR	Telekommunikation	0.44%
Unilever Indonesia Tbk PT	IDR	Basiskonsumgüter	0.48%
Samsung Electronics Co Ltd	KRW	IT	4.51%
Samsung Electronics Co Ltd	KRW	IT	0.77%
Samsung Fire & Marine Insuranc	KRW	Finanzwesen	0.25%
Samsung SDI Co Ltd	KRW	IT	0.42%
Samsung SDS Co Ltd	KRW	IT	0.55%
Samsung Securities Co Ltd	KRW	Finanzwesen	0.60%
Santander Bank Polska SA	PLN	Finanzwesen	0.46%
Shandong Weigao Group Medical	HKD	Gesundheitswesen	0.59%
Sino Biopharmaceutical Ltd	HKD	Gesundheitswesen	0.29%
Sinopharm Group Co Ltd	HKD	Gesundheitswesen	0.43%
SK Hynix Inc	KRW	IT	0.64%
SM Investments Corp	PHP	Industrie	0.30%
Taiwan Semiconductor Manufactu	TWD	IT	7.53%
Tencent Holdings Ltd	HKD	Telekommunikation	5.07%
TOTVS SA	BRL	IT	0.56%
Uni-President China Holdings L	HKD	Basiskonsumgüter	1.28%
Uni-President Enterprises Corp	TWD	Basiskonsumgüter	2.01%
United Microelectronics Corp	TWD	IT	0.73%
WEG SA	BRL	Industrie	0.65%

Basiswert	Währung	Portfoliokategorie	Gewichtung per 28.04.2023

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 Telefongespräche mit diesen Einheiten führen, stimmen der Aufzeichnung stillschweigend zu.