

ZKB MeinIndex Sustainable Emerging Markets

Reporting | Valor 13 599 733

30.04.2021

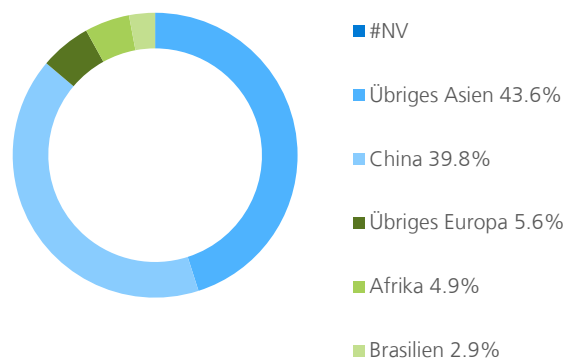
Hierbei handelt es sich in der Schweiz um Strukturierte Produkte. Sie sind keine kollektiven Kapitalanlagen im Sinne des Kollektivanlagegesetzes (KAG). Sie unterstehen weder der Genehmigungspflicht noch der Aufsicht der FINMA und Anleger geniessen nicht den spezifischen Anlegerschutz des KAG.

In Kürze

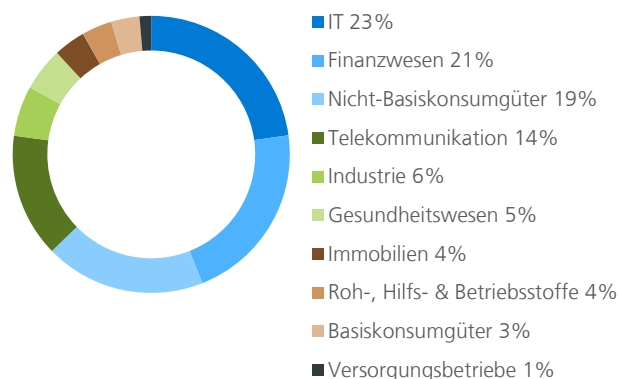
■ Systematische Titelauswahl aus dem nachhaltigen Anlageuniversum der Zürcher Kantonalbank

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

Aufteilung nach Region per 30.04.2021



Aufteilung nach Portfoliokategorie per 30.04.2021



Performancekennzahlen ZKB MeinIndex Sustainable Emerging Markets

Absolut	Annualisiert	
1Mt	-0.6%	
3Mte	3.8%	
1J	40.2%	
3J	12.6%	4.2%
5J	66.4%	13.3%
seit Lancierung	102.7%	10.8%

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.

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

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 eingestufte Titel aus dem pazifischen Raum nach Sektoren. Durch den Nachhaltigkeitsfilter sind sämtliche Energie- und Miningunternehmen ausgeschlossen.

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 30.04.2021

Basiswert	Währung	Portfoliokategorie	Gewichtung per 30.04.2021
3SBio Inc	HKD	Gesundheitswesen	1.19%
Absa Group Ltd	ZAr	Finanzwesen	0.35%
Agile Group Holdings Ltd	HKD	Immobilien	0.83%
Alibaba Group Holding Ltd	USD	Nicht-Basiskonsumgüter	5.72%
ANTA Sports Products Ltd	HKD	Nicht-Basiskonsumgüter	2.12%
Aspen Pharmacare Holdings Ltd	ZAr	Gesundheitswesen	0.49%
AU Optronics Corp	TWD	IT	0.35%
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	BRL	Finanzwesen	0.20%
Baidu Inc	USD	Telekommunikation	1.23%
Banco Bradesco SA	BRL	Finanzwesen	0.88%
Banco Santander Brasil SA	BRL	Finanzwesen	0.90%
Cemex SAB de CV	MXN	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.39%
Richter Gedeon Nyrt	HUF	Gesundheitswesen	1.39%
China Aoyuan Group Ltd	HKD	Immobilien	0.69%
China Construction Bank Corp	HKD	Finanzwesen	1.33%
China Development Financial Ho	TWD	Finanzwesen	0.45%
China Feihe Ltd	HKD	Basiskonsumgüter	0.21%
China Lesso Group Holdings Ltd	HKD	Industrie	0.93%
China Life Insurance Co Ltd	HKD	Finanzwesen	0.81%
China Longyuan Power Group Cor	HKD	Versorgungsbetriebe	0.31%
China Medical System Holdings	HKD	Gesundheitswesen	0.33%
China Merchants Bank Co Ltd	HKD	Finanzwesen	1.96%
China Pacific Insurance Group	HKD	Finanzwesen	0.61%
China Resources Cement Holding	HKD	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.78%
China Traditional Chinese Medi	HKD	Gesundheitswesen	0.37%
CJ CheilJedang Corp	KRW	Basiskonsumgüter	0.26%
Cia Energetica de Minas Gerais	BRL	Versorgungsbetriebe	0.61%
Cyfrowy Polsat SA	PLN	Telekommunikation	1.26%
Eclat Textile Co Ltd	TWD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.58%
Evergreen Marine Corp Taiwan L	TWD	Industrie	0.81%
Far East Horizon Ltd	HKD	Finanzwesen	0.99%
Fuyao Glass Industry Group Co	HKD	Nicht-Basiskonsumgüter	1.49%
Gruma SAB de CV	MXN	Basiskonsumgüter	0.51%
Grupo Financiero Banorte SAB d	MXN	Finanzwesen	1.01%
GS Engineering & Construction	KRW	Industrie	0.24%
Haitian International Holdings	HKD	Industrie	0.87%
Hana Financial Group Inc	KRW	Finanzwesen	0.39%
Hankook Tire & Technology Co L	KRW	Nicht-Basiskonsumgüter	1.06%
Hartalega Holdings Bhd	MYR	Gesundheitswesen	0.36%
Hon Hai Precision Industry Co	TWD	IT	0.72%
Hyundai Mobis Co Ltd	KRW	Nicht-Basiskonsumgüter	0.81%
Impala Platinum Holdings Ltd	ZAr	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.24%
Innolux Corp	TWD	IT	0.30%
International Container Termin	PHP	Industrie	1.12%
JD.com Inc	USD	Nicht-Basiskonsumgüter	1.42%
Kasikornbank PCL	THB	Finanzwesen	0.32%
KB Financial Group Inc	KRW	Finanzwesen	1.18%
Korea Gas Corp	KRW	Versorgungsbetriebe	0.43%
Kumba Iron Ore Ltd	ZAr	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.34%
Kumho Petrochemical Co Ltd	KRW	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.29%
KWG Group Holdings Ltd	HKD	Immobilien	0.93%
Lenovo Group Ltd	HKD	IT	1.24%
LG Electronics Inc	KRW	Nicht-Basiskonsumgüter	0.80%
Lite-On Technology Corp	TWD	IT	1.36%

Basiswert	Währung	Portfoliokategorie	Gewichtung per 30.04.2021
Lotte Shopping Co Ltd	KRW	Nicht-Basiskonsumgüter	0.28%
Minth Group Ltd	HKD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.42%
Mr Price Group Ltd	ZAr	Nicht-Basiskonsumgüter	0.31%
MultiChoice Group	ZAr	Telekommunikation	0.92%
NAVER Corp	KRW	Telekommunikation	0.21%
NH Investment & Securities Co	KRW	Finanzwesen	0.33%
Nien Made Enterprise Co Ltd	TWD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.98%
NIO Inc	USD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.88%
Novatek Microelectronics Corp	TWD	IT	0.28%
PhosAgro PJSC	USD	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.30%
Powszechna Kasa Oszczednosci B	PLN	Finanzwesen	0.49%
PLDT Inc	PHP	Telekommunikation	1.09%
Polymetal International PLC	RUB	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.40%
Postal Savings Bank of China C	HKD	Finanzwesen	0.45%
Bank Negara Indonesia Persero	IDR	Finanzwesen	0.34%
Indofood CBP Sukses Makmur Tbk	IDR	Basiskonsumgüter	0.23%
Telkom Indonesia Persero Tbk P	IDR	Telekommunikation	1.73%
PTT Global Chemical PCL	THB	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.26%
RHB Bank Bhd	MYR	Finanzwesen	0.55%
Samsung Electronics Co Ltd	KRW	IT	5.40%
Samsung Electronics Co Ltd	KRW	IT	1.26%
Samsung Securities Co Ltd	KRW	Finanzwesen	0.37%
Sanlam Ltd	ZAr	Finanzwesen	0.45%
Sberbank of Russia PJSC	RUB	Finanzwesen	2.15%
Shandong Weigao Group Medical	HKD	Gesundheitswesen	0.57%
Shenzhou International Group H	HKD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.47%
Siam Cement PCL/The	THB	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.49%
Sime Darby Bhd	MYR	Industrie	0.31%
Sinotruk Hong Kong Ltd	HKD	Industrie	0.84%
SK Hynix Inc	KRW	IT	0.99%
Taiwan Semiconductor Manufactu	TWD	IT	8.61%
TAL Education Group	USD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.25%
Tencent Holdings Ltd	HKD	Telekommunikation	7.07%
People's Insurance Co Group of	HKD	Finanzwesen	1.98%
Siam Commercial Bank PCL/The	THB	Finanzwesen	0.38%
Tiger Brands Ltd	ZAr	Basiskonsumgüter	0.40%
Tingyi Cayman Islands Holding	HKD	Basiskonsumgüter	0.94%
Top Glove Corp Bhd	MYR	Gesundheitswesen	0.28%
Topsports International Holdin	HKD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.35%
TOTVS SA	BRL	IT	0.27%
Uni-President China Holdings L	HKD	Basiskonsumgüter	0.73%
United Microelectronics Corp	TWD	IT	1.22%
Vodacom Group Ltd	ZAr	Telekommunikation	0.80%
Westports Holdings Bhd	MYR	Industrie	0.70%
Woolworths Holdings Ltd/South	ZAr	Nicht-Basiskonsumgüter	0.62%
Xinyi Solar Holdings Ltd	HKD	IT	0.60%
Yuanta Financial Holding Co Lt	TWD	Finanzwesen	2.12%
Yuexiu Property Co Ltd	HKD	Immobilien	1.23%

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.