ZKB MeinIndex Sustainable Europa

Reporting | Valor 18 984 103 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.

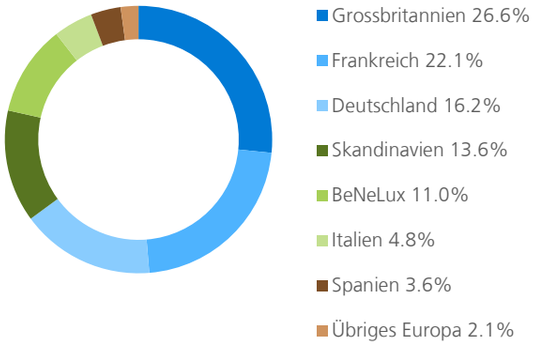
In Kürze

■ Systematische Titelauswahl aus dem nachhaltigen Anlageuniversum der Zürcher Kantonalbank

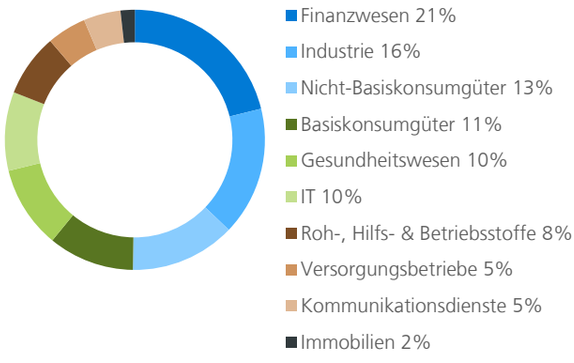
■ Investition sowohl in Branchenleader punkto Nachhaltigkeit als auch in kleinere Unternehmen mit innovativen, nachhaltigen Produkten (Innovatoren)

■ Nachhaltigkeitsziele sind in der Europäischen Union auf politischer Ebene stark verankert und werden mit finanziellen Mittel gefördert

Aufteilung nach Region per 31.12.2021



Aufteilung nach Portfoliokategorie per 31.12.2021



Performancekennzahlen ZKB MeinIndex Sustainable Europa

Absolut		Annualisiert
1Mt	5.6%	
3Mte	3.9%	
1J	19.4%	
3J	39.1%	13.0%
5J	44.0%	8.8%
seit Lancierung	135.9%	14.4%

Jahresperformance	
2013	27.2%
2014	5.7%
2015	9.0%
2016	-3.0%
2017	20.9%
2018	-14.4%
2019	19.6%
2020	-2.6%

In Europa wird ein nachhaltiges Wachstumsmodell angestrebt
Die Euro-Krise ist Folge grosser Ungleichgewichte zwischen Nord- und Südeuropa, die sich seit der Einführung der Gemeinschaftswährung 1999 aufgebaut haben. Neben der Notwendigkeit zu massiven Sparanstrengungen, strukturellen Anpassungen und mehr fiskalpolitischer Koordination ist auch die Förderung des Wachstums stärker auf die Agenda der europäischen Politik gerückt. Am EU-Gipfel von Ende Juni 2012 wurde als Ergänzung zum Fiskalpakt der „Pakt für Wachstum und Beschäftigung" definitiv verabschiedet, gemäss dem rund 120 Mrd. Euro via Europäische Investitionsbank, Projektanleihen oder Umleitung von bestehenden EU-Geldern mobilisiert werden sollen. Den weiteren Rahmen für die Koordination der Wachstumspolitik in Europa bildet die 10-Jahres-Strategie „Europe 2020" der Europäischen Kommission, welche die bis 2010 laufende Lissabon Strategie ablöste. Der Fokus der Wachstums-strategie liegt auf der Reduktion von Treibhausgasen und der Steigerung von Ressourceneffizienz, der Förderung von Bildung und Innovation sowie der Reduktion von Armut und der Steigerung von Beschäftigung. Damit sind Nachhaltig-keitsziele auf politischer Ebene stark verankert und werden mit finanziellen Mittel gefördert.

Mehrwert schaffen durch nachhaltige Unternehmen
Wer in nachhaltige Unternehmen investiert, fördert nicht nur nachhaltiges Wachstum in Europa. Er investiert in Unternehmen, welche von langfristigen Trends besser profitieren können oder von neuen Belastungen weniger betroffen sind. Unter den Grossen einer Branche sind es diejenigen, welche 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 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). Der ZKB MeinIndex Nachhaltigkeit Europa ist ein Europa-Index ex Schweiz.

Einteilung nach Sektoren
Neben Titeln aus dem MSCI Europe Index besteht das Nachhaltigkeitsuniversum auch aus weiteren nachhaltigen Unternehmen aus der Region Europa, die gewisse Mindestanforderungen an Marktkapitalisierung und Handelsvolumen erfüllen. Ausgangspunkt der Titelselektion bildet dabei zunächst die Einteilung aller als nachhaltig eingestufter Titel aus dem europäischen Raum unter dem Ausschluss der Schweiz nach Sektoren. Durch den Nachhaltigkeitsfilter sind sämtliche Energie und Miningunternehmen ausgeschlossen.

Eckdaten ZKB MeinIndex Sustainable Europa

Valor	18 984 103
Bloomberg Symbol	ZKBIEURI

Open End ZKB Tracker-Zertifikate

Valor	ISIN	Symbol	Tranche
10 716 646	CH0107166461	TREURO	Retail
10 716 647	CH0107166479	TREURI	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 Europa Komponenten per 31.12.2021

Basiswert	Währung	Portfoliokategorie	Gewichtung per 31.12.2021
AcadeMedia AB	SEK	Nicht-Basiskonsumgüter	0.81%
APERAM SA	EUR	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.45%
ASML Holding NV	EUR	IT	3.69%
Assicurazioni Generali SpA	EUR	Finanzwesen	2.76%
AstraZeneca PLC	GBp	Gesundheitswesen	1.65%
Atea ASA	NOK	IT	0.98%
Atlas Copco AB	SEK	Industrie	2.07%
Aviva PLC	GBp	Finanzwesen	2.69%
AXA SA	EUR	Finanzwesen	3.35%
Bakkavor Group PLC	GBp	Basiskonsumgüter	0.89%
Banco Santander SA	EUR	Finanzwesen	1.43%
Barratt Developments PLC	GBp	Nicht-Basiskonsumgüter	2.49%
BNP Paribas SA	EUR	Finanzwesen	1.65%
Capgemini SE	EUR	IT	1.01%
Cie Generale des Etablissement	EUR	Nicht-Basiskonsumgüter	3.02%
Cie de Saint-Gobain	EUR	Industrie	2.45%
Continental AG	EUR	Nicht-Basiskonsumgüter	1.53%
Covestro AG	EUR	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	1.84%
CRH PLC	EUR	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	1.51%
Elisa Oyj	EUR	Kommunikationsdienste	0.53%
GEA Group AG	EUR	Industrie	1.41%
GlaxoSmithKline PLC	GBp	Gesundheitswesen	3.74%
Henkel AG & Co KGaA	EUR	Basiskonsumgüter	1.35%
Henkel AG & Co KGaA	EUR	Basiskonsumgüter	1.62%
Hera SpA	EUR	Versorgungsbetriebe	0.65%
Husqvarna AB	SEK	Industrie	1.86%
ING Groep NV	EUR	Finanzwesen	1.50%
Kingfisher PLC	GBp	Nicht-Basiskonsumgüter	2.59%
Klepierre SA	EUR	Immobilien	1.08%
Koninklijke Ahold Delhaize NV	EUR	Basiskonsumgüter	0.79%
Koninklijke DSM NV	EUR	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	2.80%
Land Securities Group PLC	GBp	Immobilien	0.69%
L'Oreal SA	EUR	Basiskonsumgüter	2.88%
Merck KGaA	EUR	Gesundheitswesen	2.03%
Novo Nordisk A/S	DKK	Gesundheitswesen	1.67%
Bekaert SA	EUR	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.59%
Pandora A/S	DKK	Nicht-Basiskonsumgüter	2.64%
Pearson PLC	GBp	Kommunikationsdienste	1.31%
Red Electrica Corp SA	EUR	Versorgungsbetriebe	2.20%
Sandvik AB	SEK	Industrie	0.35%
SAP SE	EUR	IT	2.46%
Schneider Electric SE	EUR	Industrie	3.46%
Siemens AG	EUR	Industrie	3.38%
Societe Generale SA	EUR	Finanzwesen	3.23%
Standard Chartered PLC	GBp	Finanzwesen	3.17%
Symrise AG	EUR	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.59%
Telefonaktiebolaget LM Ericsso	SEK	IT	1.64%
UCB SA	EUR	Gesundheitswesen	1.13%
UniCredit SpA	EUR	Finanzwesen	1.36%
Unilever PLC	EUR	Basiskonsumgüter	3.17%
United Utilities Group PLC	GBp	Versorgungsbetriebe	1.41%
Uponor Oyj	EUR	Industrie	1.03%
Verbund AG	EUR	Versorgungsbetriebe	0.63%
Vodafone Group PLC	GBp	Kommunikationsdienste	2.78%

Basiswert	Währung	Portfoliokategorie	Gewichtung per 31.12.2021

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.