

ZKB Basket Sustainable USA

Reporting | Valor 39 941 564

31.08.2023

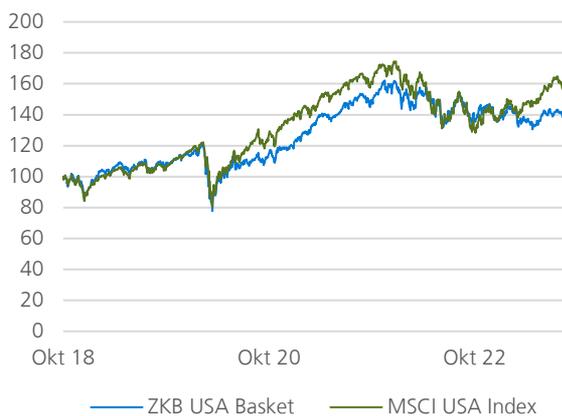
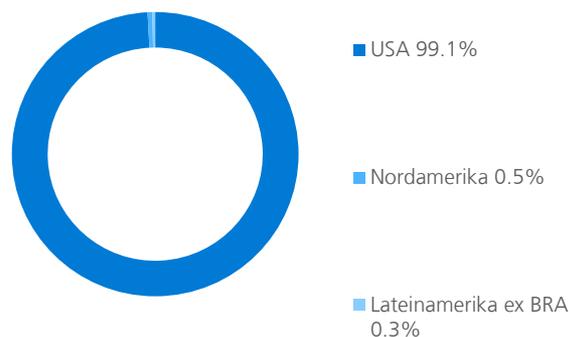
Hierbei handelt es sich in der Schweiz um Strukturierte Produkte. Sie sind keine kollektiven Kapitalanlagen im Sinne des Kollektivanlagegesetzes (KAG). Sie unterstehen weder der Genehmigungspflicht noch der Aufsicht der FINMA und Anleger geniessen nicht den spezifischen Anlegerschutz des KAG.

In Kürze

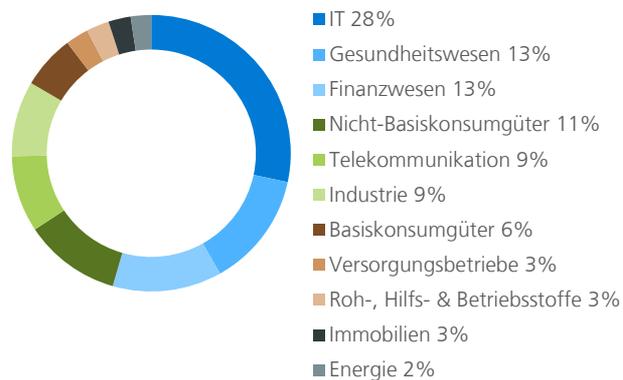
■ Systematische Titelauswahl aus dem nachhaltigen Anlageuniversum der Zürcher Kantonalbank

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

Aufteilung nach Region per 31.08.2023



Aufteilung nach Portfoliokategorie per 31.08.2023



Performancekennzahlen ZKB Basket Sustainable USA

Absolut	Annualisiert	
1Mt	0.5%	
3Mte	6.0%	
1J	-0.9%	
3J	27.6%	9.2%
5J	n/a	n/a
seit Lancierung	44.1%	9.0%

Jahresperformance	
2015	
2016	
2017	
2018	
2019	27.3%
2020	5.6%
2021	35.0%
2022	-16.1%
2023 YTD	6.3%

Beschreibung

Das Zertifikat investiert in Beteiligungspapiere von Gesellschaften, die ihr Domizil oder die überwiegende Geschäftstätigkeit in den USA 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 den USA, 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 USA.

Einteilung nach Sektoren

Neben Titeln aus dem MSCI USA Index besteht das Nachhaltigkeitsuniversum auch aus weiteren nachhaltigen Unternehmen aus den USA, die gewisse Mindestanforderungen an Marktkapitalisierung und Handelsvolumen erfüllen. Ausgangspunkt der Titelselektion bildet dabei zunächst die Einteilung aller als nachhaltig eingestufte Titel aus den USA nach Sektoren.

Eckdaten ZKB Basket Sustainable

USA

Valor	39 941 564
Bloomberg Symbol	USSUSZ

Open End ZKB Tracker-Zertifikate

Valor	ISIN	Symbol	Tranche
39 941 564	CH0399415642	USSUSZ	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 USA Komponenten per 31.08.2023

Basiswert	Währung	Portfoliokategorie	Gewichtung per 31.08.2023
3M Co	USD	Industrie	2.55%
AbbVie Inc	USD	Gesundheitswesen	1.75%
Adobe Inc	USD	IT	2.56%
Alphabet Inc	USD	Telekommunikation	0.90%
Alphabet Inc	USD	Telekommunikation	2.21%
Amazon.com Inc	USD	Nicht-Basiskonsumgüter	1.79%
ANSYS Inc	USD	IT	0.56%
Apple Inc	USD	IT	7.48%
Atkore Inc	USD	Industrie	0.65%
Axcelis Technologies Inc	USD	IT	0.42%
Bank of America Corp	USD	Finanzwesen	0.85%
Bank of New York Mellon Corp/T	USD	Finanzwesen	2.22%
Biogen Inc	USD	Gesundheitswesen	1.63%
Booking Holdings Inc	USD	Nicht-Basiskonsumgüter	2.52%
BorgWarner Inc	USD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.50%
Bristol-Myers Squibb Co	USD	Gesundheitswesen	0.95%
Brixmor Property Group Inc	USD	Immobilien	0.81%
Cardinal Health Inc	USD	Gesundheitswesen	0.26%
Cisco Systems Inc	USD	IT	1.92%
CNO Financial Group Inc	USD	Finanzwesen	0.34%
Comcast Corp	USD	Telekommunikation	1.84%
Dow Inc	USD	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	1.90%
Dropbox Inc	USD	IT	2.56%
eBay Inc	USD	Nicht-Basiskonsumgüter	2.50%
Electronic Arts Inc	USD	Telekommunikation	0.72%
Elevance Health Inc	USD	Gesundheitswesen	0.73%
Eli Lilly & Co	USD	Gesundheitswesen	3.37%
Enviva Inc	USD	Energie	2.38%
Equinix Inc	USD	Immobilien	0.81%
Essent Group Ltd	USD	Finanzwesen	0.22%
Eventbrite Inc	USD	Telekommunikation	0.31%
Everest Group Ltd	USD	Finanzwesen	0.54%
Eversource Energy	USD	Versorgungsbetriebe	2.10%
Frontdoor Inc	USD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.42%
Gentex Corp	USD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.54%
Genuine Parts Co	USD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.67%
Gilead Sciences Inc	USD	Gesundheitswesen	1.25%
GMS Inc	USD	Industrie	0.42%
Grand Canyon Education Inc	USD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.42%
International Business Machine	USD	IT	1.05%
ITT Inc	USD	Industrie	0.71%
JPMorgan Chase & Co	USD	Finanzwesen	2.02%
Kimberly-Clark Corp	USD	Basiskonsumgüter	0.68%
Kimco Realty Corp	USD	Immobilien	0.75%
Linde PLC	USD	Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	0.75%
Medpace Holdings Inc	USD	Gesundheitswesen	0.43%
MercadoLibre Inc	USD	Nicht-Basiskonsumgüter	0.31%
Merck & Co Inc	USD	Gesundheitswesen	2.02%
Meta Platforms Inc	USD	Telekommunikation	2.98%
MGIC Investment Corp	USD	Finanzwesen	0.45%
Microsoft Corp	USD	IT	5.38%
NVIDIA Corp	USD	IT	0.76%
ON Semiconductor Corp	USD	IT	0.64%
Ormat Technologies Inc	USD	Versorgungsbetriebe	0.57%

Basiswert	Wahrung	Portfoliokategorie	Gewichtung per 31.08.2023
Owens Corning	USD	Industrie	0.30%
Pfizer Inc	USD	Gesundheitswesen	0.51%
Primerica Inc	USD	Finanzwesen	0.95%
Procter & Gamble Co/The	USD	Basiskonsumguter	3.48%
QUALCOMM Inc	USD	IT	0.38%
Rambus Inc	USD	IT	0.91%
Ryman Hospitality Properties I	USD	Immobilien	0.22%
Salesforce Inc	USD	IT	0.39%
Selective Insurance Group Inc	USD	Finanzwesen	1.00%
ServiceNow Inc	USD	IT	0.73%
Synopsys Inc	USD	IT	2.62%
Taylor Morrison Home Corp	USD	Nicht-Basiskonsumguter	0.35%
TopBuild Corp	USD	Nicht-Basiskonsumguter	1.21%
United Rentals Inc	USD	Industrie	2.56%
USANA Health Sciences Inc	USD	Basiskonsumguter	2.09%
Verisk Analytics Inc	USD	Industrie	1.42%
Vertex Pharmaceuticals Inc	USD	Gesundheitswesen	0.54%
Victory Capital Holdings Inc	USD	Finanzwesen	0.87%
Visa Inc	USD	Finanzwesen	1.99%
Voya Financial Inc	USD	Finanzwesen	1.22%
Watts Water Technologies Inc	USD	Industrie	0.22%

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uckliegende 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.