

Last Month

**3.17%**

1 Yr

**25.28%**

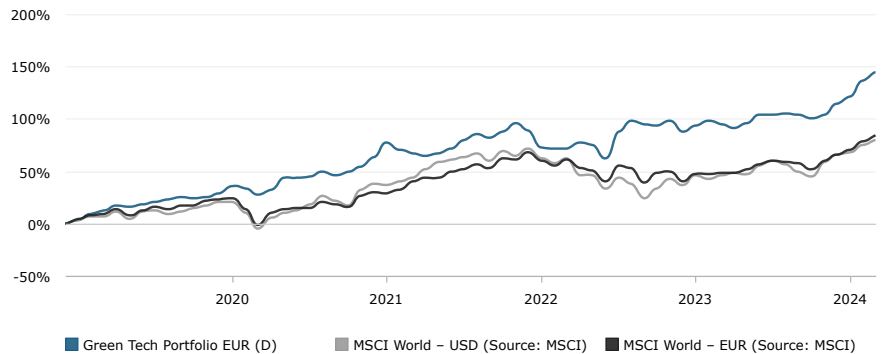
YTD

**13.81%**

Total Return Cumulative

**144.37%**

## CUMULATIVE MONTHLY RETURNS



## STRATEGY DESCRIPTION

Zweimal pro Jahr werden 25 der weltweit besten Aktien des Sektors „Green Technology“ auf der Grundlage von Qualität, Value und Momentum ausgewählt. Das Portfolio wendet eine auf Momentum basierende Verkaufsdisziplin an. Bei Verkäufen werden die resultierenden Barmittel erst wieder beim nächsten Rebalancing investiert. Das Portfolio verfolgt einen kompromisslosen Ansatz innerhalb des ESG-Konzept. Es investiert nur in Unternehmen, die messbare Auswirkungen darauf haben, die Umweltherausforderungen unseres Planeten mit innovativen Technologien zu bewältigen.

## GENERAL INFORMATION

Price / Unit	EUR 244.38
ISIN	CH04 2979 1491
Liquidity	Intraday
Minimum Investment	1 Unit
Investment Manager	Global Strategic Capital
Issuer	ZKB (AAA Rating)
Management Fee	1.0%
Issuer Fee	0.3%
Performance Fee	none
Website	www.globalstrategic.ch

## RETURN STATISTICS

Last Month	3.17%
Year To Date	13.81%
3 Month ROR	13.81%
12 Months ROR	25.28%
36 Month ROR	46.08%
Total Return Cumulative	144.37%
Total Return Annualized	18.55%
Winning Months (%)	63.49%
Average Winning Month	3.77%

## RETURN STATISTICS

Sharpe Ratio	1.33
Sortino Ratio	2.49
Max Drawdown (Monthly)	-17.05%
Correlation vs. MSCI World – USD (Source: MSCI)	0.46
Standard Deviation Monthly	3.92%
Downside Deviation	1.99%
Beta	0.35
VaR Historical	-4.62
Average Losing Month	-2.43%

	YTD	3M	1 Yr	3 Yrs	Total Return Cumulative
Green Tech Portfolio EUR (D)	13.81%	13.81%	25.28%	46.08%	144.37%
MSCI World – USD (Source: MSCI)	8.43%	8.43%	23.09%	24.89%	79.96%
MSCI World – EUR (Source: MSCI)	10.93%	10.93%	24.06%	31.37%	83.89%

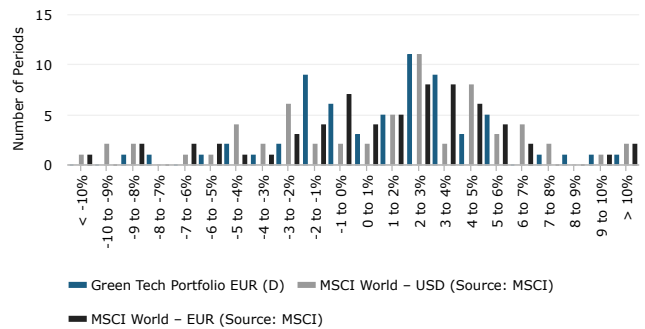
## MONTHLY PERFORMANCE

	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Year
2024	2.82	7.29	3.17										13.81
2023	2.90	2.32	-1.38	-1.85	2.50	3.96	-0.03	0.52	-0.60	-1.44	1.50	5.33	14.30
2022	-8.79	-0.42	0.26	3.11	-0.96	-7.63	15.64	5.48	-1.30	-0.64	2.20	-5.21	-0.46
2021	8.65	-4.04	-1.80	-1.30	1.37	2.78	4.46	3.33	-2.12	3.28	4.11	-3.43	15.50
2020	5.73	-1.87	-4.62	3.66	9.09	-0.65	0.93	3.78	-2.84	2.31	3.70	5.68	26.86
2019	3.65	5.37	2.72	4.51	-1.42	2.33	1.83	2.48	1.73	-1.64	1.61	2.63	28.79

## RETURN REPORT

Period	Best	Worst	Average	Median	Last
1 Month	15.64%	-8.79%	1.50%	2.20%	3.17%
3 Months	20.39%	-12.29%	4.25%	3.84%	13.81%
6 Months	22.83%	-14.10%	7.74%	8.62%	19.92%
1 Year	31.38%	-5.77%	15.13%	15.45%	25.28%
2 Years	71.27%	4.31%	31.50%	29.89%	42.20%
3 Years	88.71%	24.36%	47.45%	45.97%	46.08%
5 Years	117.82%	112.99%	115.60%	115.79%	117.82%

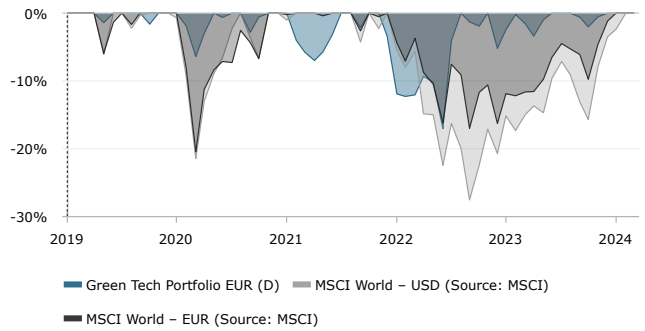
## DISTRIBUTION OF MONTHLY RETURNS



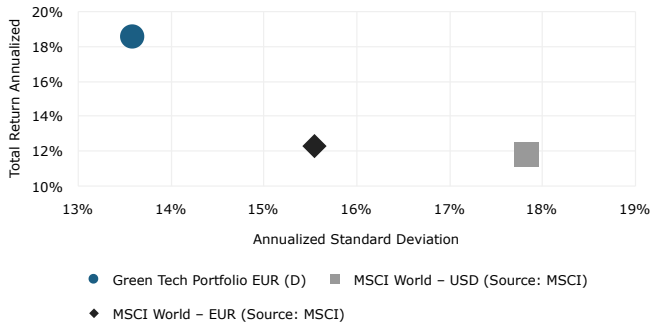
## DRAWDOWN REPORT

No.	Depth (%)	Length (Months)	Recovery (Months)	Start date	End date
1	-17.05%	7	2	12/2021	08/2022
2	-6.99%	3	3	02/2021	07/2021
3	-6.40%	2	2	02/2020	05/2020
4	-5.21%	1	6	12/2022	06/2023
5	-2.84%	1	2	09/2020	11/2020

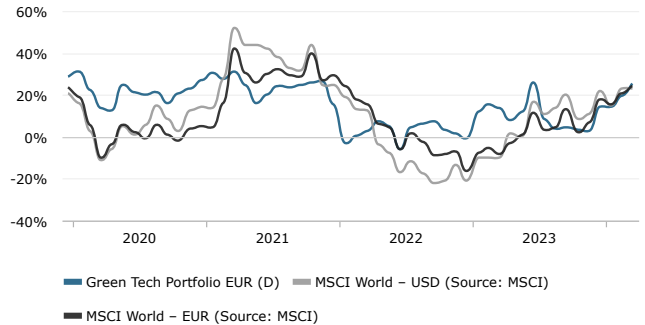
## DRAWDOWN



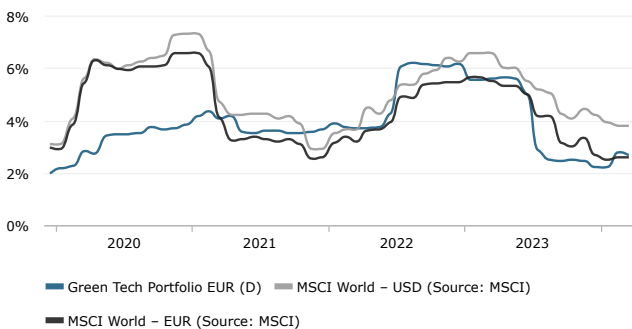
## RISK/RETURN COMPARISON



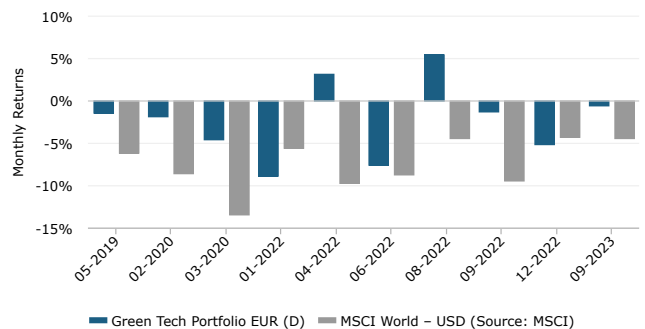
## 12 MONTH ROLLING ROR



## VOLATILITY (12 MONTHS ROLLING)



## DOWN CAPTURE VS. MSCI WORLD - USD (SOURCE: MSCI)



**Signifikante Risiken für Investoren**

Verpflichtungen aus diesen Strukturierten Produkten begründen unmittelbare, unbedingte und unbesicherte Verpflichtungen der Emittentin und sind mit anderen direkten, bedingungslosen und ungesicherten Verpflichtungen der Emittentin gleichrangig. Der Wert des Strukturierten Produkts hängt nicht nur von der Wertentwicklung des Basiswerts und anderen Entwicklungen auf den Finanzmärkten ab, sondern auch von der Zahlungsfähigkeit des Emittenten, die sich während der Laufzeit dieses Strukturierten Produkts ändern kann. Strukturierte Produkte sind komplexe Finanzinstrumente, die mit erheblichen Risiken verbunden sind und sich daher nur für Anleger eignen, die über die erforderlichen Kenntnisse und Erfahrungen verfügen und die mit einer Anlage in diese strukturierten Produkte verbundenen Risiken gut verstehen und die wirtschaftlichen Risiken tragen können. ZKB Tracker Certificate Dynamic ist ein Anlageprodukt, dessen Preis sich in demselben Maße wie der Basiswert abzüglich etwaiger Gebühren ändert. Abhängig von der Preisentwicklung kann der Preis eines ZKB Tracker Certificate Dynamic unter den Emissionspreis fallen. Das Risikoprofil des ZKB Tracker Certificate Dynamic entspricht dem des Basiswerts. Das ZKB Tracker-Zertifikat Dynamic lautet auf USD. Der Anleger trägt alle Risiken im Zusammenhang mit einem möglichen Wechselkursrisiko zwischen der Produktwährung, der Währung der Bestandteile des Basiswerts und seiner Referenzwährung. Wenn ein außergewöhnliches Ereignis in Bezug auf den Basiswert / eine Komponente des Basiswerts eintritt, das es der Emittentin unmöglich oder besonders schwerfällig macht, ihre Verpflichtungen aus den Strukturierten Produkten zu erfüllen oder den Wert der Strukturierten Produkte zu berechnen, die Emittentin unternimmt nach eigenem Ermessen alle erforderlichen Maßnahmen und kann, falls erforderlich, die Bedingungen und Konditionen dieser Strukturierten Produkte nach eigenem Ermessen dahingehend ändern, dass der wirtschaftliche Wert der Strukturierten Produkte nach Eintritt des außergewöhnlichen Ereignisses dem entspricht soweit möglich, auf den wirtschaftlichen Wert der Strukturierten Produkte vor Eintritt des außergewöhnlichen Ereignisses. Stellt die Emittentin aus irgendeinem Grund fest, dass eine angemessene Änderung nicht möglich ist, hat die Emittentin das Recht, die Strukturierten Produkte vorzeitig zurückzuzahlen. Kann aufgrund des Auftretens einer Marktstörung in Bezug auf den Basiswert / eine Komponente des Basiswerts kein Marktpreis ermittelt werden, bestimmen die Emittentin oder die Berechnungsstelle den Marktpreis des Basiswerts / des Basiswerts an seinem Basiswert nach freiem Ermessen, unter Berücksichtigung der allgemeinen Marktbedingungen und des letzten Marktpreises des jeweiligen Basiswerts / Bestandteils des Basiswerts, der von der Marktstörung betroffen ist, hat er das Recht, den Rückzahlungstag auf die erste Bank zu verschieben, wenn die Marktstörung am Rücknahmetag bestehen bleibt Tag, an dem die Marktstörung beendet ist. Sie vergleicht die Bestimmungen des Emissionsprogramms, das Vorrang hat. Diese Bestimmung gilt entsprechend für die Ermittlung des Wertes der Strukturierten Produkte, wenn der Basiswert / eine Komponente des Basiswerts von einer Marktstörung betroffen ist. Die Emittentin behält sich das Recht der vorzeitigen Kündigung für alle im Rahmen dieses Emissionsprogramms emittierten Strukturierten Produkte aus steuerlichen Gründen vor (z. B. in Fällen, in denen die Emittentin aufgrund neuer Steuergesetze zur Zahlung zusätzlicher Beträge verpflichtet wäre) aus der Einbehaltung oder dem Abzug der gegenwärtigen oder zukünftigen Steuern, Abgaben, Gebühren oder Gebühren (unabhängig von der Art) sowie im Falle von Einschränkungen in Bezug auf ihre Tätigkeit als Emittent durch neue Gesetze oder Verwaltungsmaßnahmen (z. B. wenn dies verboten ist) aufsichtsrechtlich durch Ausgabe von Strukturierten Produkten). Während der Laufzeit des Strukturierten Produkts können sich Änderungen oder eine Ersetzung des Basiswerts durch die Berechnungsstelle ergeben. In diesem Fall kann nicht ausgeschlossen werden, dass solche Änderungen oder Ersetzungen den Wert des Strukturierten Produkts negativ beeinflussen. Ebenso kann nicht ausgeschlossen werden, dass sich bei einem Strukturierten Produkt aufgrund eines Indexes die Zusammensetzung des Index aufgrund von Änderungen oder Substitutionen einzelner Indexkomponenten ändert, beispielsweise infolge der Rücknahme oder die Hinzufügung einzelner Wertpapiere kann den Preis des Index und damit den Wert des Strukturierten Produkts negativ beeinflussen. Es gelten die im Issuance-Programm enthaltenen Verkaufsbeschränkungen (EEA, USA / US-Personen, Guernsey). Insbesondere dürfen diese Publikation und die darin enthaltenen Informationen von keiner Person (unabhängig davon, ob sie privat ist) weitergegeben und / oder weitergegeben werden oder eine juristische Person), die möglicherweise eine US-amerikanische Person gemäß Regulation S des US Securities Act von 1933 ist. Zu den US-Personen zählen alle in den USA ansässigen Personen. Körperschaften, Gesellschaften, Personengesellschaften oder sonstigen Körperschaften, die nach den Gesetzen der Vereinigten Staaten organisiert sind; und andere in der Verordnung S. Die Emittentin hat keine Maßnahmen ergriffen, um das öffentliche Angebot der Strukturierten Produkte oder den Besitz oder die Verbreitung von Dokumenten, die im Zusammenhang mit der Ausgabe der Strukturierten Produkte in einem anderen Rechtsraum als der Schweiz erstellt wurden, zuzulassen. Die Verteilung dieser Endgültigen Bedingungen oder anderer Dokumente, die im Zusammenhang mit der Ausgabe der Strukturierten Produkte erstellt wurden, sowie das Angebot, der Verkauf und die Lieferung der Strukturierten Produkte in bestimmten Rechtsordnungen können gesetzlich eingeschränkt sein. Personen, die diese Endgültigen Bedingungen oder andere Dokumente erhalten haben, die im Zusammenhang mit der Ausgabe der Strukturierten Produkte erstellt wurden, wie beispielsweise das Emissionsprogramm, Termsheets, Marketing- oder sonstiges Verkaufsmaterial, sind von der Emittentin verpflichtet, sich darüber zu informieren und diese zu beachten solche Einschränkungen. Dies ist keine Anlageempfehlung. Falls Sie investieren möchten, wenden Sie sich bitte an Ihre Bank.

**MSCI Disclaimer**

<https://www.msci.com/notice-and-disclaimer-for-reporting-licenses>