

FINANZLAB MULTI INDEX FUND

Monatsbericht - Juni 2024

Basisdaten

Lancierung	20. Oktober 2021
Rechtsstruktur	Vertraglicher Anlagefonds
Fondsvermögen	CHF 29.56 Mio.
NAV	CHF 115.25
Zeichnungen / Rücknahmen	Täglich 12:00 CET
Total Expense Ratio (TER)	0.75%
ISIN	CH0582155336

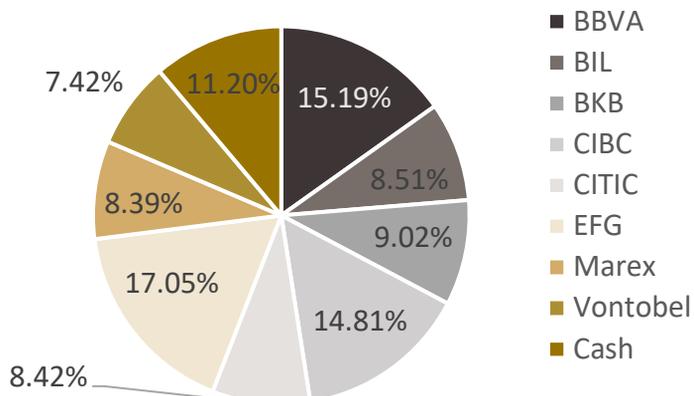
Monatlicher Kommentar

Das zweite Quartal endete mit einem neuen Rekord des S&P 500, der vor allem von der Performance der Magnificent Seven, insbesondere Nvidia, angetrieben wurde. Der CAC 40 hingegen wurde von der Rückkehr des politischen Risikos hart getroffen und ist damit der einzige unserer Indizes, der im Jahresverlauf wieder in den roten Bereich gerutscht ist. Die Auswirkungen blieben jedoch begrenzt, da alle Barrieren der zugehörigen Produkte über 45% ihres Ausgangsniveaus lagen. Mit einer Performance von über 7% verzeichnete der Kospi 200 den grössten Zuwachs des Monats. Was neue Produkte betrifft, haben wir eine neue Emission in Zusammenarbeit mit CITIC Securities, einem chinesischen Emittenten, gemacht, was unseren Zugang zu asiatischen Indizes mit einem Coupon von 6,18% vorteilhaft erweitert. Der Fonds beendete den Monat bei CHF 115.25, was einem Anstieg von 1.41% seit Jahresbeginn entspricht.

Anlagepolitik

Das Ziel des Fonds besteht darin, eine effiziente Anlage in ein diversifiziertes Portfolio von strukturierten Produkten des Typs Barrier Reverse Convertible zu ermöglichen, welche ausschließlich auf Aktienindizes der wichtigsten Industrieländer basieren (sogenannte Multi-Index-Produkte). Diese Strategie implementiert einen systematischen Verkauf von exotischen Optionen und damit die Einnahme von überbewerteten Risikoprämien. Der Fonds strebt ein absolutes Kapitalwachstum an.

Verteilung der Emittenten



Fragen

Welcher Index liegt am nächsten an seiner Barriere? Welcher Anteil des Kapitals ist exponiert?

Der CAC 40 müsste um weitere 45.28% fallen, damit die Barriere des Produkts auf den NASDAQ, OMX Stockholm, CAC 40, DAX mit Fälligkeitsdatum 26.03.2026 erreicht wird. Der Fonds ist zu 7.42% des Vermögens in diesem Produkt investiert.

Wie hoch ist der durchschnittliche Coupon der im Fonds enthaltenen Produkte?

5.72% p.a.

Z FINANZLAB

Finanzlab SA
Avenue Sainte-Luce 4
1003 Lausanne

+41 21 310 70 00
www.finanzlab.ch

FINANZLAB MULTI INDEX FUND

Monatsbericht - Juni 2024

Positionen (Klicken Sie auf die ISIN, um zum Termsheet zu gelangen)

Type	% of assets	ISIN Emittent / Garant	Indizes	Coupon p.a	Barriere
BRC	6.79%	XS2515320369 BBVA	Hang Seng, ASX 200, KOSPI2	7.00%	50% (laufend)
BRC	6.83%	XS2663157597 CIBC	Nikkei 225, S&P 500, OMX Stockholm	7.00%	50% (laufend)
BRC	8.75%	CH1322069415 EFG	AEX, DAX, IBEX	5.30%	50% (laufend)
BRC	8.51%	CH1322027595 BIL	DAXK, NASDAQ, FTSE 100, CAC 40	5.40%	50% (laufend)
BRC	8.30%	CH1332465405 EFG	SMI, S&P 500, EURO STOXX 50, CAC 40	5.00%	50% (laufend)
BRC	9.02%	CH1261619196 BKB	IBEX, Nikkei 225, OMX Stockholm	5.16%	50% (laufend)
BRC	7.98%	XS2792570736 CIBC	ASX 200, TSX 60, EURO STOXX 50, FTSE 100	5.04%	50% (laufend)
BRC	7.42%	CH1332573687 Vontobel	NASDAQ, OMX Stockholm, CAC 40, DAX	5.25%	50% (laufend)
BRC	8.40%	XS2759805281 BBVA	Hang Seng, KOSPI 200, CAC 40, IBEX	6.30%	50% (laufend)
BRC	8.39%	XS2748036733 Marex	AEX, NASDAQ, EURO STOXX 50	5.80%	50% (laufend)
BRC	8.42%	XS2797978173 CITIC	ASX 200, Hang Seng, Nikkei 225, FTSE 100	6.18%	50% (laufend)
Cash	11.20%	Frankfurter Bankgesellschaft (Schweiz) AG			

Monatliche NAV und YTD Performance

	Jan	Feb	März	Apr	Mai	Juni	Juli	Aug	Sept	Okt	Nov	Dez	YTD
2021										99.98	99.43	99.86	-0.14%
2022	99.25	97.65	98.92	97.87	98.42	95.61	99.86	98.46	96.20	100.12	102.16	101.68	+1.83%
2023	106.03	106.49	108.08	108.75	109.76	110.41	110.86	110.76	110.85	110.89	112.79	113.65	+11.77%
2024	113.83	114.13	114.60	114.76	114.93	115.25							+1.41%

► Verfolgen Sie den Fonds auf: products.finanzlab.ch

Fondsmanager	Fondsleitung	Depotbank	Revisionsstelle
Finanzlab SA Lausanne	LLB Swiss Investment AG Zürich	Frankfurter Bankgesellschaft (Schweiz) AG, Zürich	PwC AG Zürich



Dieses Dokument ist eine Marketingmitteilung. Dieses Dokument ist ausschliesslich für qualifizierte Anlegerinnen und Anleger gemäss Art. 10 Abs. 3 und 3ter des Bundesgesetzes über die kollektiven Kapitalanlagen ("KAG") bestimmt. Es stellt weder ein Angebot noch eine Empfehlung dar, Anlagefonds zu kaufen oder zu verkaufen. Die Informationen stehen unter dem Vorbehalt jederzeitiger Änderung. Diese Informationen berücksichtigen weder die spezifischen oder künftigen Anlageziele noch die steuerliche oder finanzielle Lage oder die individuellen Bedürfnisse des einzelnen Empfängers. Die Angaben in diesem Dokument werden ohne jegliche Garantie oder Zusicherung zur Verfügung gestellt, dienen ausschliesslich zu Informationszwecken und sind lediglich zum persönlichen Gebrauch des Empfängers bestimmt. Investitionen in den Fonds sollten nur nach gründlichem Studium des aktuellen Prospekts mit integriertem Fondsvertrag erfolgen. Anteile des Fonds können in verschiedenen Gerichtsbarkeiten oder für gewisse Anlegergruppen für den Verkauf ungeeignet oder unzulässig sein und dürfen innerhalb der USA weder angeboten noch verkauft oder ausgeliefert werden. Der Preis und der Wert der Anlagen sowie jegliches daraus resultierende Einkommen können schwanken. Anleger müssen darauf gefasst und in der finanziellen Lage sein, (allenfalls erhebliche) Kursverluste verkraften zu können. Die vergangene Performance ist keine Garantie für laufende und zukünftige Entwicklungen. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt. Der Fonds verzichtet auf einen Benchmarkvergleich. Die rechtlichen Fondsdokumente sind unentgeltlich bei der Fondsleitung, der LLB Swiss Investment AG, Claridenstrasse 20, CH-8002 Zürich oder auf der Website www.swissfonddata.ch erhältlich.