

FINANZLAB MULTI INDEX FUND

Rapport mensuel – août 2024

Caractéristiques

Lancement	20 octobre 2021
Structure juridique	Fonds de placement contractuel
Actifs totaux	CHF 30.69 Mio
VNI	CHF 116.19
Souscription / rachat (cut-off)	Tous les jours 12:00 CET
Total expense ratio (TER)	0.75%
ISIN	CH0582155336

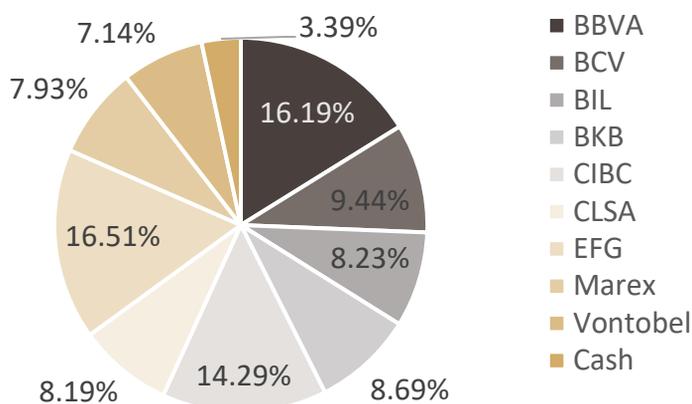
Commentaire mensuel

Le mois a commencé par un net recul de nos indices le 5 août, suivi d'une reprise au milieu du mois. Cette baisse était due aux craintes de récession aux États-Unis et à une éventuelle erreur de politique monétaire de la Fed. La reprise a été soutenue par l'annonce que la banque centrale américaine pourrait réduire ses taux en septembre. De plus, des résultats trimestriels solides ont contribué à cette reprise. Malgré la présence, parmi nos indices, du Nikkei (qui a clôturé ce 'lundi noir' avec la plus forte baisse de son histoire) et du Kospi, le fonds n'a reculé ce jour-là que de 1,37 %, contre 2,80 % pour le SMI, 3 % pour le S&P 500 et 1,45 % pour l'Euro Stoxx 50. Un niveau record a même été atteint le 19 août à CHF 116,25. Il n'y a eu ni remboursement ni nouveau produit durant la période. Le fonds termine le mois à CHF 116,19, en progression de 2,23 % depuis le début de l'année.

Objectif d'investissement

L'objectif du fonds est de permettre un investissement efficient dans un portefeuille diversifié de produits structurés de type Barrier Reverse Convertible qui sont exclusivement basés sur des indices d'actions des principaux pays industrialisés (produits dits multi-index). Cette stratégie implémente une vente systématique d'option exotiques et ainsi une récolte de primes de risques surévaluées, et vise une croissance absolue du capital.

Répartition des émetteurs



Questions

Quel est l'indice le plus proche de sa barrière ? Quelle part du capital est exposée ?

Il faudrait que l'indice Hang Seng baisse encore de 46.35% pour que la barrière du produit sur Hang Seng, ASX 200, Kospi 200 avec date d'échéance le 08.12.2025 soit atteinte. Le fonds est investi à hauteur de 6.58% des actifs dans ce produit.

Quel est le coupon moyen des produits contenus dans le fonds?

5.67% p.a.

 FINANZLAB

Finanzlab SA
Avenue Sainte-Luce 4
1003 Lausanne

+41 21 310 70 00
www.finanzlab.ch

FINANZLAB MULTI INDEX FUND

Rapport mensuel - août 2024

Positions (Cliquez sur l'ISIN pour accéder au termsheet)

Type	% of assets	ISIN Emetteur / Garant	Indices	Coupon p.a	Barrière
BRC	6.58%	XS2515320369 BBVA	Hang Seng, ASX 200, KOSPI 200	7.00%	50% (continue)
BRC	6.56%	XS2663157597 CIBC	Nikkei 225, S&P 500, OMX Stockholm	7.00%	50% (continue)
BRC	8.46%	CH1322069415 EFG	AEX, DAX, IBEX	5.30%	50% (continue)
BRC	8.23%	CH1322027595 BIL	DAXK, NASDAQ, FTSE 100, CAC 40	5.40%	50% (continue)
BRC	8.05%	CH1332465405 EFG	SMI, S&P 500, EURO STOXX 50, CAC 40	5.00%	50% (continue)
BRC	8.69%	CH1261619196 BKB	IBEX, Nikkei 225, OMX Stockholm	5.16%	50% (continue)
BRC	7.73%	XS2792570736 CIBC	ASX 200, TSX 60, EURO STOXX 50, FTSE 100	5.04%	50% (continue)
BRC	7.14%	CH1332573687 Vontobel	NASDAQ, OMX Stockholm, CAC 40, DAX	5.25%	50% (continue)
BRC	9.61%	XS2759805281 BBVA	Hang Seng, KOSPI 200, CAC 40, IBEX	6.30%	50% (continue)
BRC	7.93%	XS2748036733 Marex	AEX, NASDAQ, EURO STOXX 50	5.80%	50% (continue)
BRC	8.19%	XS2797978173 CLSA	ASX 200, Hang Seng, Nikkei 225, FTSE 100	6.18%	50% (continue)
BRC	9.44%	CH1368550005 BCV	SMI, S&P 500, EURO STOXX 50, IBEX	5.05%	50% (continue)
Cash	3.39%	Frankfurter Bankgesellschaft (Schweiz) AG			

VNI mensuelle et performance YTD

	Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Juin	Juil	Août	Sept	Oct	Nov	Déc	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	116.12	116.19					+2.23%

► suivre l'évolution du fonds sur: products.finanzlab.ch

Gestion	Direction de fonds	Banque dépositaire	Auditeur
Finanzlab SA Lausanne	LLB Swiss Investment AG Zürich	Frankfurter Bankgesellschaft (Schweiz) AG, Zürich	PwC AG Zürich



Ce document est une publication marketing. Ce document est exclusivement destiné aux investisseurs qualifiés au sens de l'art. 10 al. 3 et 3^{ter} de la loi fédérale sur les placements collectifs de capitaux ("LPCC"). Il ne constitue ni une offre ni une recommandation d'achat ou de vente de fonds de placement. Les informations sont fournies sous réserve de modification à tout moment. Ces informations ne tiennent pas compte des objectifs d'investissement spécifiques ou futurs, ni de la situation fiscale ou financière, ni des besoins individuels des différents destinataires. Les informations contenues dans ce document sont fournies sans aucune garantie ni engagement d'aucune sorte, à titre d'information uniquement et sont destinées à l'usage personnel du destinataire uniquement. Les investissements dans le fonds ne devraient être effectués qu'après une étude approfondie du prospectus actuel avec contrat de fonds intégré. Les parts du fonds peuvent être inadaptées ou interdites à la vente dans différentes juridictions ou pour certains groupes d'investisseurs et ne peuvent être ni proposées, ni vendues, ni livrées aux États-Unis. Le prix et la valeur des investissements, ainsi que tout revenu en décaissant, peuvent fluctuer. Les investisseurs doivent être prêts et en mesure d'assumer des pertes de cours (éventuellement importantes). La performance passée ne garantit pas les évolutions en cours et futures. Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais prélevés lors de l'émission et du rachat des parts. Le fonds renonce à toute comparaison avec un indice de référence. Les documents juridiques du fonds peuvent être obtenus gratuitement auprès de la direction du fonds, LLB Swiss Investment AG, Claridenstrasse 20, CH-8002 Zürich ou sur le site Internet www.swissfunddata.ch.