

# FINANZLAB MULTI INDEX FUND

## Monatsbericht - Oktober 2024

### Basisdaten

Lancierung	20. Oktober 2021
Rechtsstruktur	Vertraglicher Anlagefonds
Fondsvermögen	CHF 31.13 Mio.
NAV	CHF 116.60
Zeichnungen / Rücknahmen	Täglich 12:00 CET
Total Expense Ratio (TER)	0.75%
ISIN	CH0582155336

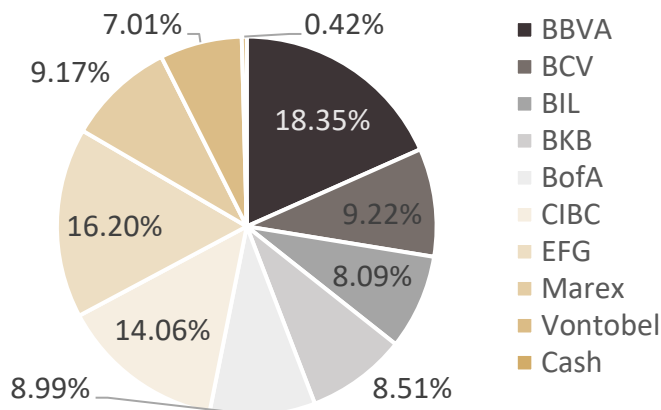
### Monatlicher Kommentar

Halloween-Selloff! Das Monatsende war geprägt von einem Einbruch der Technologiewerte und wachsenden vorwahlbedingten Unsicherheiten. Enttäuschende Unternehmenszahlen führten zu zahlreichen Kursverlusten. Der Oktober zählt – wie bereits der April – zu den schwächsten Börsenmonaten des Jahres. Einzig der Nikkei trotz dem Trend und schliesst mit einem Plus von 3 %. Auch die Volatilität ist zurück: Der VIX steht bei 23,16, was einer monatlichen Veränderung von +38,43 % entspricht (und einem Anstieg von +86 % seit Jahresbeginn). Positiv zu vermerken ist die US-Inflationsrate, die mit rund 2 % das Szenario einer Zinssenkung um 0,25 % in der kommenden Woche stützt. Zwei neue Emissionen wurden als Ersatz für zurückgezahlte Produkte lanciert, mit Coupons von 6,36 % bzw. 6,04 %. Der Fonds schliesst den Monat mit einem Stand von CHF 116,60 ab und liegt seit seinem Start vor drei Jahren bei einem Plus von 16,60 %.

### 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 44.32% 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 7.01% des Vermögens in diesem Produkt investiert.

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

5.64% p.a.

 FINANZLAB

Finanzlab SA  
Avenue Sainte-Luce 4  
1003 Lausanne

+41 21 310 70 00  
www.finanzlab.ch

# FINANZLAB MULTI INDEX FUND

## Monatsbericht - Oktober 2024

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

Type	% of assets	ISIN Emittent / Garant	Indizes	Coupon p.a	Barriere
BRC	6.41%	<a href="#">XS2663157597</a> CIBC	Nikkei 225, S&P 500, OMX Stockholm	7.00%	50% (laufend)
BRC	8.32%	<a href="#">CH1322069415</a> EFG	AEX, DAX, IBEX	5.30%	50% (laufend)
BRC	8.09%	<a href="#">CH1322027595</a> BIL	DAXK, NASDAQ, FTSE 100, CAC 40	5.40%	50% (laufend)
BRC	7.88%	<a href="#">CH1332465405</a> EFG	SMI, S&P 500, EURO STOXX 50, CAC 40	5.00%	50% (laufend)
BRC	8.51%	<a href="#">CH1261619196</a> BKB	IBEX, Nikkei 225, OMX Stockholm	5.16%	50% (laufend)
BRC	7.65%	<a href="#">XS2792570736</a> CIBC	ASX 200, TSX 60, EURO STOXX 50, FTSE 100	5.04%	50% (laufend)
BRC	7.01%	<a href="#">CH1332573687</a> Vontobel	NASDAQ, OMX Stockholm, CAC 40, DAX	5.25%	50% (laufend)
BRC	9.52%	<a href="#">XS2759805281</a> BBVA	Hang Seng, KOSPI 200, CAC 40, IBEX	6.30%	50% (laufend)
BRC	9.17%	<a href="#">XS2748036733</a> Marex	AEX, NASDAQ, EURO STOXX 50	5.80%	50% (laufend)
BRC	9.22%	<a href="#">CH1368550005</a> BCV	SMI, S&P 500, EURO STOXX 50, IBEX	5.05%	50% (laufend)
BRC	8.82%	<a href="#">XS2879185267</a> BBVA	DAX, FTSE 100, Hang Seng, Nikkei 225	6.36%	50% (laufend)
BRC	8.99%	<a href="#">XS2850471454</a> BofA	EURO STOXX 50, S&P 500, SMI, OMX Stockholm	6.04%	50% (laufend)
Cash	0.42%	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	116.12	116.19	116.51	116.60			+2.60%

▶ Verfolgen Sie den Fonds auf: [products.finanzlab.ch](https://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.swissfunddata.ch](http://www.swissfunddata.ch) erhältlich.