

FINANZLAB MULTI INDEX FUND

Monatsbericht - Dezember 2024

Basisdaten

| | |
|---------------------------|---------------------------|
| Lancierung | 20. Oktober 2021 |
| Rechtsstruktur | Vertraglicher Anlagefonds |
| Fondsvermögen | CHF 32.13 Mio. |
| NAV | CHF 118.09 |
| Zeichnungen / Rücknahmen | Täglich 12:00 CET |
| Total Expense Ratio (TER) | 0.75% |
| ISIN | CH0582155336 |

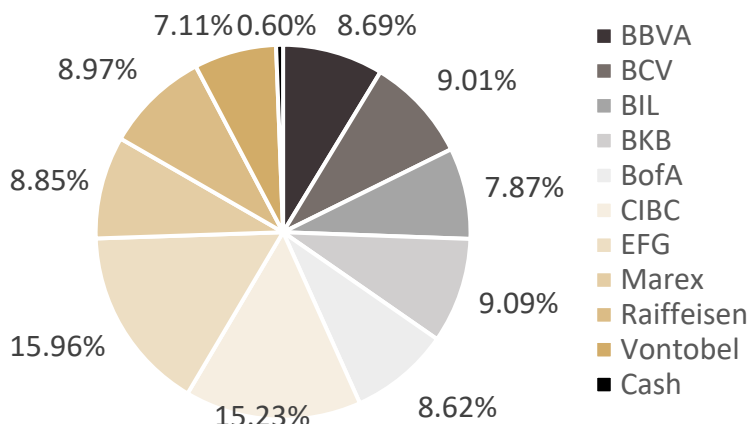
Monatlicher Kommentar

Das war's... 2024 war ein gutes bis sehr gutes Börsenjahr, mit Ausnahme des französischen Marktes. Der CAC 40 verzeichnete einen Rückgang von rund 3%, während alle anderen grossen internationalen Märkte mehr oder weniger deutliche Zuwächse erzielten. In diesem Monat richteten wir unser Augenmerk auf Südkorea, wo eine traurige menschliche Tragödie, eine schwere demokratische Krise und Unterhaltung die Schlagzeilen dominierten. Während die zweite Staffel von Squid Game die Top 10 der Netflix-Serien eroberte, sehen sich die Institutionen mit einer beunruhigenden demokratischen Instabilität konfrontiert. Das Länderrisiko stellt eine Bedrohung dar, die wir nicht im Fonds tragen möchten. Aus diesem Grund haben wir unsere einzige Position im Kospi 200 mit Gewinn bei 100,72 verkauft. Der Fonds schloss das Jahr bei CHF 118,09, was einer Jahresperformance von +3,91% und einer Volatilität von 1,02% entspricht. Über drei Jahre hinweg beträgt die annualisierte Performance +5,76 % bei einer Volatilität von 5,24%.

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 44.55% 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 7.11% des Vermögens in diesem Produkt investiert.

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

5.53% 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 - Dezember 2024

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

| Type | % of assets | ISIN Emittent / Garant | Indizes | Coupon p.a | Barriere |
|------|-------------|--|---|---------------|------------------|
| BRC | 6.27% | XS2663157597 CIBC | Nikkei 225, S&P 500, OMX Stockholm | 7.00% | 50% (laufend) |
| BRC | 7.44% | CH1322069415 EFG | AEX, DAX, IBEX | 5.30% | 50% (laufend) |
| BRC | 7.87% | CH1322027595 BIL | DAXK, NASDAQ, FTSE 100, CAC 40 | 5.40% | 50% (laufend) |
| BRC | 8.52% | CH1332465405 EFG | SMI, S&P 500, EURO STOXX 50, CAC 40 | 5.00% | 50% (laufend) |
| BRC | 9.09% | CH1261619196 BKB | IBEX, Nikkei 225, OMX Stockholm | 5.16% | 50% (laufend) |
| BRC | 8.96% | XS2792570736 CIBC | ASX 200, TSX 60, EURO STOXX 50, FTSE 100 | 5.04% | 50% (laufend) |
| BRC | 7.11% | CH1332573687 Vontobel | NASDAQ, OMX Stockholm, CAC 40, DAX | 5.25% | 50% (laufend) |
| BRC | 8.85% | XS2748036733 Marex | AEX, NASDAQ, EURO STOXX 50 | 5.80% | 50% (laufend) |
| BRC | 9.01% | CH1368550005 BCV | SMI, S&P 500, EURO STOXX 50, IBEX | 5.05% | 50% (laufend) |
| BRC | 8.69% | XS2879185267 BBVA | DAX, FTSE 100, Hang Seng, Nikkei 225 | 6.36% | 50% (laufend) |
| BRC | 8.62% | XS2850471454 BofA | EURO STOXX 50, S&P 500, SMI, OMX Stockholm | 6.04% | 50% (laufend) |
| BRC | 8.97% | CH1399955983 Raiffeisen | AEX, CAC 40, NASDAQ, DAX | 5.25% | 50% (laufend) |
| Cash | 0.60% | 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 | 117.83 | 118.09 | +3.91% |

► 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.swissfunddata.ch erhältlich.