

RAIFFEISEN FOND OPTIMÁLNÍHO ROZLOŽENÍ

ISIN: CZ000847431



Charakteristika fondu

- Prostředky fondu alokovány do široké škály aktiv na rozličných trzích
- Široce diverzifikovaný, korunový smíšený fond
- Eliminace možnosti chyby lidského faktoru a emocí díky využití kvantitativního trendového modelu
- Investice spojená s rizikem tržním, měnovým, úvěrovým a nedostatečné likvidity

Vývoj hodnoty podílového listu fondu



1M	3M	6M	2017	2016	2015	od vzniku
1,21 %	1,84 %	2,55 %	2,26 %	1,73 %	-3,15 %	0,71 % p.a. / 1,97 %

Komentář portfolio manažera

Polovina majetku fondu zůstává ve vazbě na používaný kvantitativní model zainvestována v CZK dluhopisech. Zhruba třetina byla ke konci ledna alokována v globálních akcích a jim obdobných instrumentech, cca 13,2 % majetku je alokováno v komoditách a 6,5 % majetku je drženo v hotovosti.

Jan Chytrý, portfolio manažer

Největší pozice v majetku fondu

SPDR S&P 500 ETF Trust			10,47 %
Vanguard FTSE Pacific ETF			8,31 %
CZGB 3.85 09/29/21	A+	Česká republika	7,49 %
Vanguard FTSE Emerging Markets			7,1 %
SPDR Gold Shares			7,04 %
UNICZ 6 04/27/18	AA-	Unicredit Bank	6,43 %
PowerShares DB Commodity Index			6,18 %
ERSTBK 0 01/28/19	A-	Erste Group	4,89 %
LPTY 0.88 06/02/20	BBB+	Leaseplan Corp.	4,81 %
HYN0E 0 09/16/20	A		3,67 %

* Pokud budou podílové listy drženy méně než 3 roky

Upozornění

V souladu se zákonnou úpravou platnou pro oblast kolektivního investování upozorňujeme, že minulé výkonnost fondu nezaručuje stejnou výkonnost i v budoucím období. Hodnota investice a výnos z ní mohou kolísat a návratnost původně investované částky není zaručena. Investice do fondů kolektivního investování nespádají pod režim pojištění vkladů. Úplné názvy fondů a další informace, včetně informací o poplatcích a rizicích obsažených v investicích, jsou k dispozici v češtině na www.rfis.cz.

Základní údaje o fondu

Referenční období	7. 4. 15 - 31. 1. 18
Typ fondu	smíšený
Největší zastoupení aktiv	akcie
Měna fondu	CZK
Objem fondu (NAV)	819,5 mil. Kč
Úplata investiční společnosti	1,0 %
Vstupní poplatek	0,0 %
Výstupní poplatek *	3,0 %

Ukazatele

Volatilita (p. a.)	3,00 %
VaR (99%, 1M)	2,03 %
Max. pokles	5,03 %
Průměrná modifikovaná splatnost	0,53
Průměrný výnos do splatnosti	0,42 %
Průměrný kupon	1,11 %
Celkový počet pozic	24

Fond byl zařazen do rizikové skupiny 4

← Zpravidla nižší výnos Zpravidla vyšší výnos →

← Nižší riziko Vyšší riziko →

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

Doporučený investiční horizont



Měnová alokace fondu



Struktura cenných papírů podle investičních témat

