

RAIFFEISEN FOND OPTIMÁLNÍHO ROZLOŽENÍ

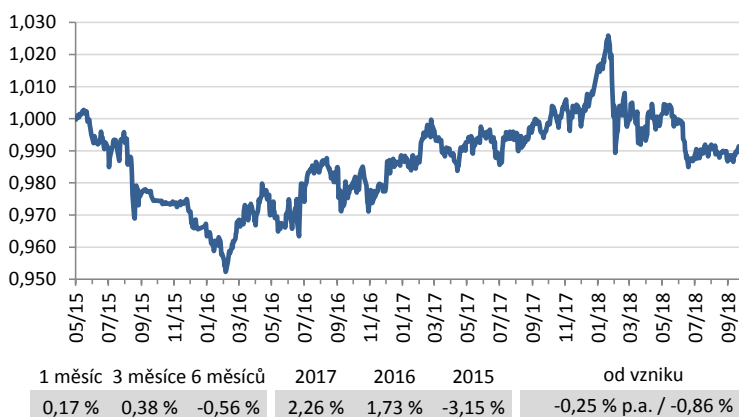
ISIN: CZ0008474731



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



Komentář portfolio manažera

Majetek Fondu optimálního rozložení je investován v závislosti na výstupech interního kvantitativního modelu, který určuje, do kterých tříd aktiv a v jakých objemech bude fond nakupovat. Jedná se tzv. trendový model, který se snaží zachytit aktuální rostoucí trendy na různých trzích a participovat na nich a zároveň se vyhýbá trhům, na kterých takový trend není. Model se od výraznějšího poklesu akcií na začátku roku této třídy aktiv spíše vyhýbá (aktuálně cca 20 % majetku) a je investováno do aktuálně více volatilních aktiv (například komodit či realitního trhu).

Jan Chytrý, portfolio manažer

Největší pozice v majetku fondu

Invesco DB US Dollar Index Bul			11,93 %
CZGB 3.85 09/29/21	Česká republika	A+	9,66 %
Invesco DB Commodity Index Tra			8,48 %
SPDR S&P 500 ETF Trust			5,54 %
Vanguard S&P 500 ETF			5,36 %
ERSTBK 0 01/28/19	Erste Group Bank	A	4,53 %
LPTY 0.88 06/02/20	Leaseplan Corp.	BBB+	4,42 %
BPCEGP 0 02/04/23		A	3,42 %
HYNOE 0 09/16/20		A	3,40 %
CZGB 1 1/2 10/29/19	Hypo Noe LB	AA-	3,39 %

Upozornění

V souladu se zákonnou úpravou platnou pro oblast kolektivního investování upozorňujeme, že minulá 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 - 30. 9. 18
Typ fondu	smíšený
Největší zastoupení aktiv	akcie
Měna fondu	CZK
Objem fondu (NAV)	888,2 mil. Kč
Úplata investiční společnosti	1,2 %
Vstupní poplatek	1,0 %
Výstupní poplatek	0,0 %

Ukazatele

Volatilita (p. a.)	3,15 %
VaR (99%, 1M)	2,13 %
Max. pokles	5,03 %
Průměrná modifikovaná splatnost	0,46
Průměrný výnos do splatnosti	0,81 %
Průměrný kupon	0,97 %
Celkový počet pozic	23

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

CZK	96%
Jiné	4%

Struktura cenných papírů podle investičních témat

