

RAIFFEISEN FOND OPTIMÁLNÍHO ROZLOŽENÍ

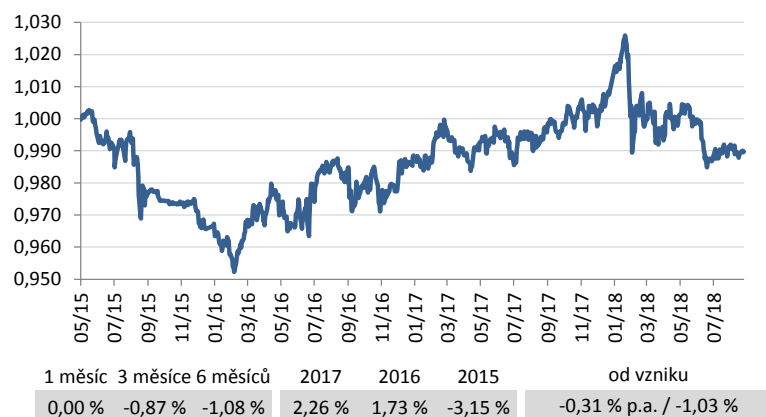
ISIN: CZ0008474731



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 a je investováno například do komodit či realitního trhu.

Jan Chytrý, portfolio manažer

Největší pozice v majetku fondu

Invesco DB US Dollar Index Bul			14,64 %
CZGB 3.85 09/29/21	Česká republika	A+	9,59 %
SPDR S&P 500 ETF Trust			7,47 %
Vanguard S&P 500 ETF			5,29 %
CZGB 0 1/4 02/10/27	Česká republika	AA-	4,84 %
ERSTBK 0 01/28/19	Erste Group Bank	A	4,47 %
LPTY 0.88 06/02/20	Leaseplan Corp.	BBB+	4,36 %
CZGB 1 1/2 10/29/19	Česká republika	AA-	3,40 %
BPCEGP 0 02/04/23		A	3,37 %
HYNOE 0 09/16/20	Hypo Noe LB	A	3,36 %

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 - 31. 8. 18
Typ fondu	smíšený
Největší zastoupení aktiv	akcie
Měna fondu	CZK
Objem fondu (NAV)	900,1 mil. Kč
Úplata investiční společnosti	1,2 %
Vstupní poplatek	1,0 %
Výstupní poplatek	0,0 %

Ukazatele

Volatilita (p. a.)	3,18 %
VaR (99%, 1M)	2,15 %
Max. pokles	5,03 %
Průměrná modifikovaná splatnost	0,86
Průměrný výnos do splatnosti	0,76 %
Průměrný kupon	0,85 %
Celkový počet pozic	21

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

