

# 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



## Komentář portfolio manažera

Rozložení majetku v závislosti na výstupech používaného kvantitativního modelu bylo v březnu následující: 52 % v českých firemních a státních dluhopisech; 26 % v akciích investovaných globálně; 15 % v komoditách a 7 % majetku drží fond v hotovosti.

Jan Chytrý, portfolio manažer

## Největší pozice v majetku fondu

PowerShares DB Commodity Index	12,70 %
Vanguard FTSE Emerging Markets	11,46 %
CZGB 3.85 09/29/21 (Česká republika)	A+ 8,77 %
CZGB 1 1/2 10/29/19 (Česká republika)	A+ 6,97 %
UNICZ 6 04/27/18 (Unicredit Bank)	AA- 4,87 %
ERSTBK 0 01/28/19 (Erste Group)	A- 3,92 %
LPTY 0.88 06/02/20 (Leaseplan Corp.)	BBB+ 3,87 %
HYN0E 0 09/16/20	A 2,94 %
Vanguard S&P 500 ETF	2,91 %
Xtrackers DAX UCITS ETF	2,62 %

\* Pokud budou podílové listy drženy méně než 3 roky

## 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](http://www.rfis.cz).

## Základní údaje o fondu

Referenční období	7. 4. 15 - 31. 3. 18
Typ fondu	smíšený
Největší zastoupení aktiv	akcie
Měna fondu	CZK
Objem fondu (NAV)	865,9 mil. Kč
Úplata investiční společnosti	1,0 %
Vstupní poplatek	0,0 %
Výstupní poplatek *	3,0 %

## Ukazatele

Volatilita (p. a.)	3,26 %
VaR (99%, 1M)	2,20 %
Max. pokles	5,03 %
Průměrná modifikovaná splatnost	0,55
Průměrný výnos do splatnosti	0,39 %
Průměrný kupon	1,06 %
Celkový počet pozic	21

Fond byl zařazen do rizikové skupiny 4

← Zpravidla nižší výnos Zpravidla vyšší výnos →

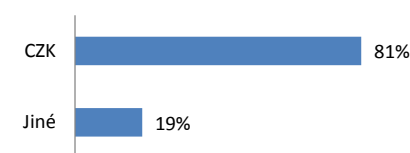
← Nižší riziko Vyšší riziko →

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

## Doporučený investiční horizont



## Měnová alokace fondu



## Struktura cenných papírů podle investičních témat

