

# RAIFFEISEN FOND OPTIMÁLNÍHO ROZLOŽENÍ

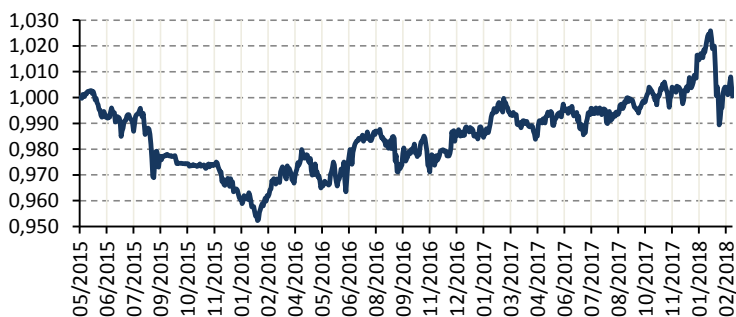
ISIN: CZ000847431



## 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
-1,88 %	-0,34 %	0,36 %	2,26 %	1,73 %	-3,15 %	0,02 % p.a. / 0,05 %

## Komentář portfolio manažera

Polovina majetku fondu zůstává ve vazbě na používaný kvantitativní model zainvestována v CZK dluhopisech. Zhruba třetina byla ke konci února alokována v globálních akcích a jim obdobných instrumentech, cca 12,5 % majetku je alokováno v komoditách a 10,7 % majetku drží fond v hotovosti.

Jan Chytrý, portfolio manažer

## Největší pozice v majetku fondu

CZGB 3.85 09/29/21	A+	Česká republika	10,56 %
CZGB 1 1/2 10/29/19	A+	Česká republika	8,40 %
UNICZ 6 04/27/18	AA-	Unicredit Bank	6,22 %
Vanguard FTSE Pacific ETF			5,76 %
SPDR Gold Shares			5,70 %
SPDR S&P 500 ETF Trust			5,23 %
PowerShares DB Commodity Index			5,17 %
Vanguard FTSE Emerging Markets			5,08 %
ERSTBK 0 01/28/19	A-	Erste Group	4,72 %
LPTY 0.88 06/02/20	BBB+	Leaseplan Corp.	4,66 %

## Základní údaje o fondu

Referenční období	7. 4. 15 - 28. 2. 18
Typ fondu	smíšený
Největší zastoupení aktiv	akcie
Měna fondu	CZK
Objem fondu (NAV)	849,7 mil. Kč
Úplata investiční společnosti	1,0 %
Vstupní poplatek	0,0 %
Výstupní poplatek *	3,0 %

## Ukazatele

Volatilita (p. a.)	3,22 %
VaR (99%, 1M)	2,17 %
Max. pokles	5,03 %
Průměrná modifikovaná splatnost	0,69
Průměrný výnos do splatnosti	0,48 %
Průměrný kupon	1,29 %
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
---	---	---	---	---	---	---

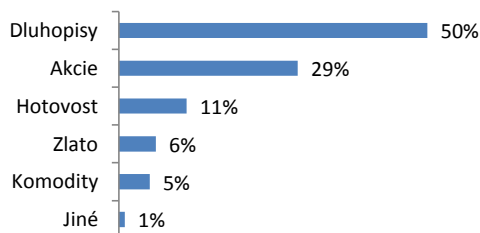
## Doporučený investiční horizont



## Měnová alokace fondu



## Struktura cenných papírů podle investičních témat



\* 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).