Raiffeisen Index Prémium Származtatott Alap

Havi Jelentés

a **2019.07.01.** - **2019.07.31.** időszakra

Raiffeisen Befektetési Alapkezelő Zrt.
1054 Bp. Akadémia u. 6.|alapok.raiffeisen.hu

Alap Adatok

Az Alap indulása	2005.08.11.
Alapkezelő	Raiffeisen Befektetési Alapkezelő Zrt.
Al-alapkezelő	-
Letétkezelő	Raiffeisen Bank Zrt.
Könyvvizsgáló	RSM DTM AUDIT Tanácsadó Kft.
Vezető Forgalmazó	Raiffeisen Bank Zrt.
Az Alap típusa	abszolút hozamcélú alap

Stratégia

A Raiffeisen Index Prémium célja, hogy az eszközosztályok széles köréből válogatva maximális tőkenövekményt érjel el úgy, hogy közben az alap értékvesztését előre meghatározott módon korlátozza. Az alap származtatott ügyletekbe, más befektetési alapok jegyeibe, részvényekbe és kamatozó eszközökbe egyaránt fektethet, akár piaci esésre játszó pozíciókat is tarthat. Az alap jelenleg olyan stratégiát követ, melynek célja az alap lehetséges legnagyobb vesztesége egy év alatt jó eséllyel ne haladja meg a 20%-ot.

Hozamok

év	hozam (%)	árfolyam (Ft)	nettó eszközérték (Ft)
2019	-5,96	1,365127	1 274 016 800
2018	-4,50	1,451820	1 968 086 640
2017	-0,24	1,520303	3 439 725 706
2016	3,78	1,523900	2 398 786 593
2015	2,14	1,468371	1 157 476 081
2014	3,37	1,437635	1 465 230 943
2013	3,13	1,390810	880 810 516
2012	6,97	1,348589	315 085 171
2011	-1,27	1,260712	921 202 632
2010	2,29	1,276987	677 099 624
2009	7,15	1,248384	1 397 397 121

A hozam százalékos mértéke a befektető által elérhető forgalmazási költségek levonása előtti nettó hozamot mutatja be, amennyiben a teljes évben megtartotta befektetését, és az esetlegesen kifizetett hozamot visszafektette az alapba. A befektetési alap forgalmazásával (vétel, tartás, eladás) kapcsolatos költségek az alap kezelési szabályzatában és a forgalmazási helyeken megismerhetők.
A múltbeli hozamok nem jelentenek garanciát az alap jövőbeli teljesítményére nézve.
A közölt hozamadatok nominálisak és az adott naptári évre vonatkoznak. Az alap indulásának évében és az idei évben a hozamok egy évnél rövidebb időre vonatkoznak, emiatt azok nem évesített hozamok.

Kockázati Profil

Alacsonyabb kockázat — Magasabb kockázat

Tipikusan alacsonyabb hozam — Tipikusan magasabb hozam

1	**2**	**3**	**4**	**5**	**6**	**7**

Ajánlott minimális befektetési időtáv

1hét	**1hó**	**6hó**	**1év**	**2év**	**3év**	**5év**

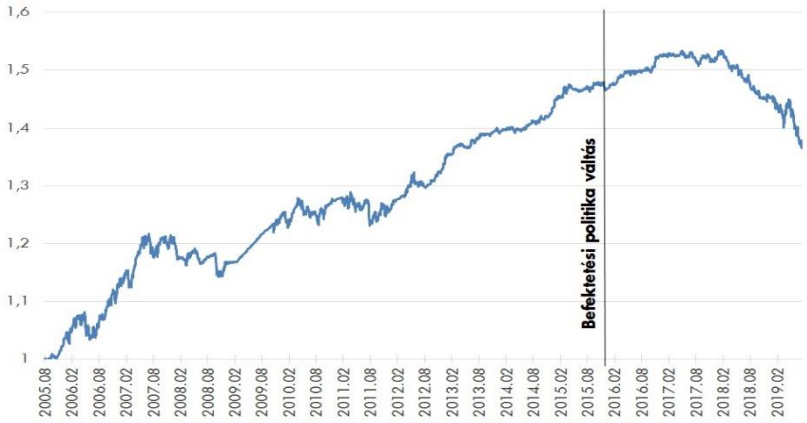
10%-nál nagyobb arányú eszközök

név	arány (%)
MFB202110/1 Kötvény	12,28

10%-nál nagyobb arányú kibocsátók

név	arány (%)
Magyar Fejlesztési Bank Zrt.	22,10

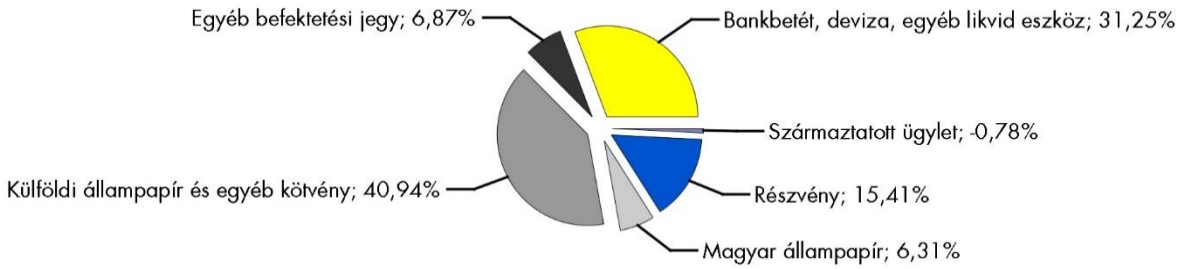
Az alap árfolyama, viszonyítási pont: 2005.08.15



Kiegészítő Információk

A Raiffeisen Befektetési Alapkezelő Zrt. tagja a Befektetési Alapkezelők és Vagyonkezelők Magyarországi Szövetségének (BAMOSZ).
A Raiffeisen Index Prémium Alap „abszolút hozamcélú alap" a BAMOSZ kategorizálása szerint.

Az alap összetétele az adott hónap végén, a tervezett elemek szerinti bontásban*



*A grafikon az Alap Tájékoztatójában és Kezelési Szabályzatában megadott eszközkategóriák szerinti bontásban mutatja be az Alap eszközeit az adott hónap utolsó napján.

Kockázati mutatók

Szórás	2,69%
Nettó összesített kockázati kitettség	145,22%
Kockáztatott érték (VaR) limit:	20%

Kockázati mutatók értelmezése

Szórás	A befektetési alap árfolyamingadozásának erősségét mutatja meg. Minél magasabb az értéke, az alap hozamai átlagosan annál jobban eltérhetnek az átlagos hozamszinttől az elmúlt három évben.
Nettó összesített kockázati kitettség	Megmutatja, hogy az alapban lévő származtatott eszközök figyelembe vételével mekkora a nettósított kockázati kitettség a nettó eszközértékhez viszonyítva.
Kockáztatott érték (VaR) limit	Segít megmutatni, hogy mekkora a maximális várható veszteség normál piaci körülmények között, adott valószínűség mellett, egy adott időszak alatt (tartási idő), az adott portfólió esetén. Az Alap esetében 99%-os konfidencia szint melleti értéket közöltünk, egy éves időszakra vonatkozóan.

További fontos információk

Az alap befektetési politikájáról, forgalmazási költségeiről és a befektetés lehetséges kockázatairól részletesen tájékozódjon az Alap forgalmazási helyein található kiemelt befejtetői információjából, hivatalos tájékoztatójából és kezelési szabályzatából. Befektetési döntése előtt minden esetben ismerje meg a fenti dokumentumokat. Annak ellenére, hogy a jelen kiadványunk pontossága, helyessége érdekében a lehető legteljesebb körültekintéssel jártunk el az Alapkezelő nem tud garanciát vállalni az abban foglaltakért. Az Alapkezelő és annak munkatársai nem vállalnak felelősséget azért az üzleti döntésért, vagy annak valamely következményéért, melyet bármely személy a jelen kiadványban foglaltak alapján hoz.
Felhívjuk a befektetők figyelmét arra, hogy a befektetési jegy tulajdonosokra egységes szabályként érvényes, hogy a hozamot, valamint a befektetési jegyre kötött ügyleten elért árfolyamnyereséget személyi jövedelemadó terheli (15%), amennyiben a befektetési jegyek megvétele 2006. augusztus 31. után történt, illetve a törvényben megfogalmazott egyéb kivételek nem állnak fenn. Felhívjuk továbbá arra is a figyelmet, hogy a befektetőket számlavezetési és egyéb költségek, valamint befektetési jegyek forgalmazása során a vételi, eladási és átváltási jutalék is terheli. A fenti költségek mértékéről a befektetési alap tájékoztatója és a befektetési jegy forgalmazójának kondíciós listája ad pontos tájékoztatást.