

# Raiffeisen Hozam Prémium Származtatott Alap

## Havi Jelentés

a 2019.09.01 - 2019.09.30 időszakra



# Raiffeisen ALAPOK

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

### Alap adatai

Az Alap indulása	2006.01.13.
Alapkezelő	Raiffeisen Befektetési Alapkezelő Zrt.
Letétkezelő	Raiffeisen Bank Zrt.
Könyvvizsgáló	RSM DTM AUDIT Tanácsadó Kft.
Vezető Forgalmazó	Raiffeisen Bank Zrt.
Az Alap típusa	abszolút hozamcélú alap

### Kiegészítő Információk

A Raiffeisen Befektetési Alapkezelő Zrt. tagja a Befektetési Alapkezelők és Vagyonkezelők Magyarországi Szövetségének (BAMOSZ), melynek kategorizálása szerint az Alap "abszolút hozamcélú alap".

### Nettó eszközérték

Sorozat (ISIN)	Árfolyam	Nettó eszközérték
"A" sorozat (HU0000703699)	1,709603	1 587 672 075 Ft
"Q" sorozat (HU0000722871)	1,003200	10 032 Ft
"R" sorozat (HU0000719216)	0,994130	801 427 722 Ft
<b>Összesen</b>		<b>2 389 109 829 Ft</b>

### Kockázati mutatók

Szórás ("A" sorozat)	2,72%
Nettó összesített kockázati kitétség	156,72%
Kockázatotott érték (VaR) limit:	11,63%

### Kockázati mutatók értelmezése

**Szórás:** A befektetési alap árfolyamingadozásának erősségét mutatja meg. Minél magasabb az értéke, az alap hozamai (átlagosan) annál jobban eltértek az átlagos éves hozamszinttől az elmúlt három évben. A "Q" és az "R" sorozatra vonatkozóan historikusan nem áll rendelkezésre a szórás számításához szükséges 36 havi hozamadat.

**Nettó összesített kockázati kitétség:** Megmutatja, hogy az alapban lévő származtatott eszközök figyelembe vételével mekkora a nettósított kockázati kitétség a nettó eszközértékhez viszonyítva. Az Alap esetében az Alapkezelő a szorzószerű módszer szerint számított értéket jelenti.

**Kockázatotott érték (VaR) limit:** A maximális várható veszteség normál piaci körülmények között, adott valószínűség (konfidenciaszint) mellett, adott időszak alatt (tartási idő) a portfólió nettó eszközértékének arányában. Az Alap esetében 99%-os konfidenciaszint melletti értéket közlünk, egy éves időszakra vonatkozóan.

### Stratégia

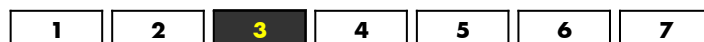
A Raiffeisen Hozam Prémium Származtatott Alap célja, hogy közepes kockázatvállalással az aktuális pénzpiaci hozamszintet legalább 2 százalékponttal meghaladó hozamot érjen el úgy, hogy közben az Alap értékvesztését előre meghatározott módon korlátozza. Ennek érdekében az Alapkezelő az eszközosztályok széles köréből választja ki az általa megfelelőnek tartott befektetési célpontokat. Az Alap állampapírokon és betéteken felül egyéb kamatozó eszközökbe (mint pl. vállalati kötvényekbe), származtatott ügyletekbe, más befektetési alapok jegyeibe és részvényekbe egyaránt fektethet. Az Alap jelenleg olyan stratégiát követ, melynek célja, hogy 2017. július 3-tól kezdődően az Alap kockázatotott érték módszer szerinti lehetséges legnagyobb vesztesége egy év alatt jó eséllyel ne haladja meg a 11,63%-ot.

### Kockázati kategória

Alacsonyabb kockázat Magasabb kockázat

←-----→

Tipikusan alacsonyabb hozam Tipikusan magasabb hozam



### Ajánlott minimális befektetési időtáv



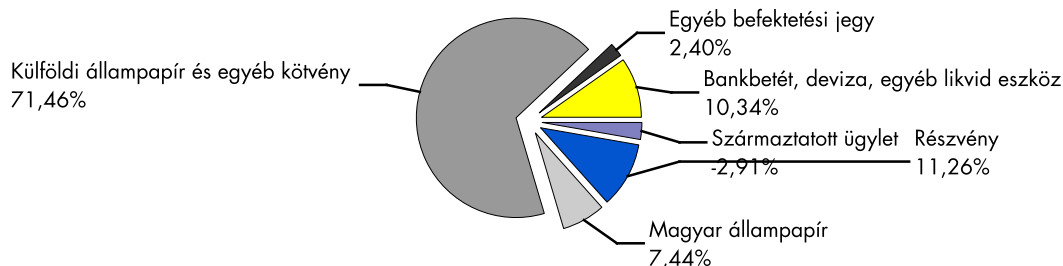
### 10%-nál nagyobb arányú eszközök

név	arány (%)
CROATIA 191105 USD 6,75	26,57

### 10%-nál nagyobb arányú kibocsátók

név	arány (%)
Horvát Köztársaság	26,57
Magyar Fejlesztési Bank Zrt.	17,85

### Az Alap hó végi összetétele 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.

## **További fontos információk**

Az alap befektetési politikájáról, forgalmazási költségeiről és a befektetés lehetséges kockázatairól részletesen tájékozódjon az Alap forgalmazási helyein található kiemelt befektetői 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.