

# Raiffeisen Index Prémium Származtatott Alap

Havi Jelentés

a 2019.04.01 - 2019.04.30 időszakra



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

## Alap Adatok

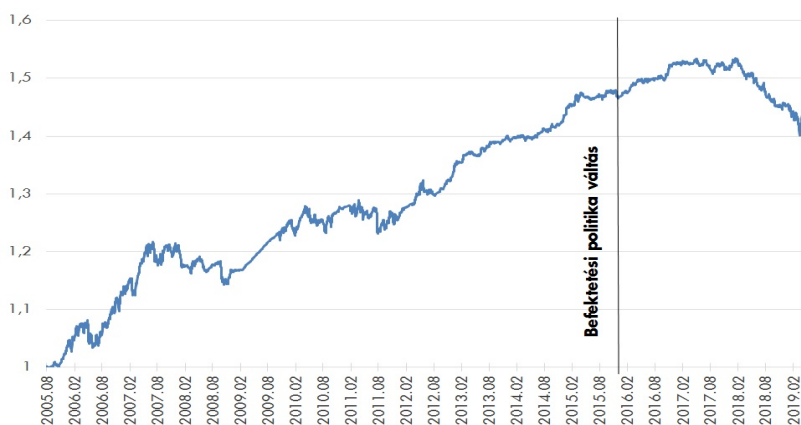
|                   |  |
|-------------------|--|
| Az Alap indulása  | 2005.08.11.                            |
| Alapkezelő        | Raiffeisen Befektetési Alapkezelő Zrt. |
| Al-alapkezelő     | -                                      |
| Letétkezelő       | Raiffeisen Bank Zrt.                   |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

## Hozamok

| év   | hozam (%) | árfolyam (Ft) | nettó eszközérték (Ft) |
|------|-----------|---------------|------------------------|
| 2019 | -0,77     | 1,440654      | 1 615 815 233          |
| 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 hozam adatok nominálisak és az adott naptári évre vonatkoznak. Az alap indulásának évében és az idejében a hozamok egy évnél rövidebb időre vonatkoznak.

## Az alap árfolyama, viszonyítási pont: 2005.08.15



## Stratégia

A Raiffeisen Index Prémium célja, hogy az eszközosztályok széles köréből válogatva maximális tőkenövekményt érj 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.

## 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 (%) |
|---------|-----------|
| D190731 | 15,47     |

## 10%-nál nagyobb arányú kibocsátók

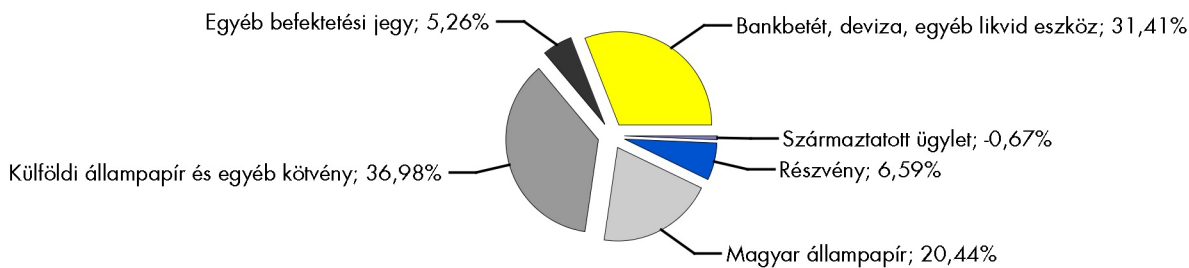
| név                          | arány (%) |
|------------------------------|-----------|
| Magyar Állam                 | 20,44     |
| Magyar Fejlesztési Bank Zrt. | 17,04     |

## 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                                | 2,29%   |
| Nettó összesített kockázati kitettség | 201,27% |
| Kockázatosított érték (VaR) limit:    | 20%     |

### Kockázati mutatók értelmezése

|                                       |   |
|---------------------------------------|---|
| Szórás                                | A befektetési alap árfolyamigadozásának 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 alapon lévő származtatott eszközök figyelembe vételével mekkora a nettósított kockázati kitettség a nettó eszközértékhez viszonyítva.   |
| Kockázatosított 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 melletti értéket közlünk, 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 befektetési 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.