



FWR Multi-Asset Strategy II

otvoreni investicijski fond s javnom ponudom



31.10.2017.

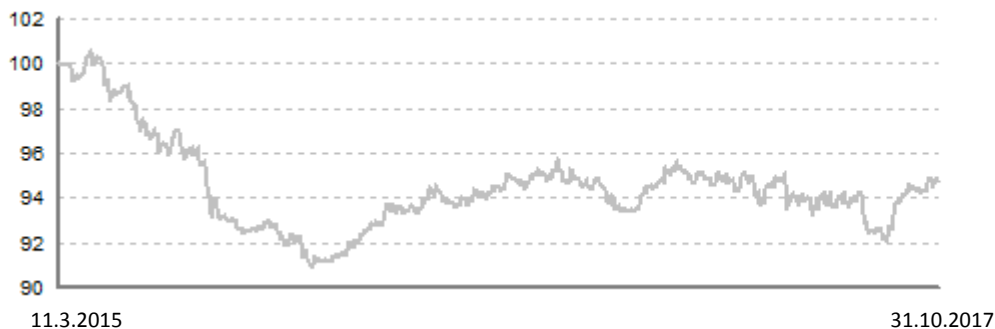
OSNOVNI PODACI

Društvo za upravljanje	Raiffeisen Invest d.o.o.
Depozitar	Raiffeisenbank Austria d.d.
Vrsta fonda	posebni
Valuta fonda	EUR
Datum osnivanja	11.03.2015.
Cijena pri osnivanju	100 EUR
ISIN	HRRBAIUMAS24
Burzovna oznaka	RBAI-U-MAS2
Bloomberg oznaka	NA
Minimalna prva uplata	30.000 EUR / 250.000 HRK
Minimalna uplata	0 EUR / 0 HRK
Minimalna uplata inv. plan	N/A EUR / N/A HRK
Ulazna naknada	1%
Izlazna naknada	0%
Naknada depozitaru	Najviše 0,2%
Naknada za upravljanje	Najviše 1,5%

Ulagateljski ciljevi i strategija ulaganja UCITS fonda

Ulagateljski cilj Fonda je ostvarivanje pozitivnog prinosa u dugom roku. Fond prinos nastoji ostvariti uglavnom kroz prikupljanje prihoda od kamata na financijske instrumente, porasta cijena financijskih instrumenata, te prihoda od dividendi. Ostvarivanje pozitivnog prinosa u razumnom roku je cilj Fonda, međutim, Društvo ne jamči za ostvarenje ulagateljskog cilja. Fond nastoji ostvariti ulagateljski cilj ulažući u sve dopuštene vrste imovine. Udio svake pojedine vrste imovine u Fondu dinamički se mijenja ovisno o kretanjima na globalnim tržištima kapitala.

Kretanje cijene udjela u fondu



Neto imovina i cijena udjela

Neto imovina fonda	HRK 18,39 mil
	EUR 2,45 mil
Cijena udjela	EUR 94,72

Prinosi u zadnjih 5 godina

2015.	-8,84
2016.	4,00

Prinos u 2017.	Prinos 1g	Prinos od osnivanja (p.a.)
-0,09%	0,46%	-2,03%

Pokazatelj rizika

Volatilitnost (p.a.)* 4,03%

*referentno razdoblje 12 mjeseci

Izloženost prema vrsti

% NAV

Futures ugovori	73,52%
Obveznice	37,46%
Neto novac i novčani ekvivalenti	35,80%
Zapisi	16,33%
Dionice	10,41%

Naknada za upravljanje i naknada depozitnoj banci uračunata je u cijenu udjela.

Prinosi iz prošlosti imaju samo informativni karakter i ne predstavljaju mogućnost ili projekciju mogućeg prinosa u budućnosti. Prinos ne uključuje troškove ulaznih i izlaznih naknada. Kad bi ih uključili, prinos Fonda bio bi niži od navedenog. Prinos se računa kao postotak promjene cijene udjela Fonda u određenom razdoblju. Prosječni godišnji prinos računa se kao geometrijski prosjek prinosa u razdoblju.

Prije ulaganja svaki Ulagatelj dužan je upoznat se s Ključnim informacijama za ulagatelje, Prospektom i Pravilima Fonda. Ključne informacije za ulagatelje Prospekt i Pravila Fonda, te opširnije informacije dostupni su na internet stranici Društva www.rbainvest.hr, na RBA info telefonu 072 62 62 62, te u svim poslovnica RBA.

Top 10 pozicija % NAV

Futures ugovori LONG S&P500 EMINI FUT Dec17	18,05%
Zapisi MINISTARSTVO FINACIJA RH HRRHMT745X5	16,33%
Futures ugovori SHORT NIKKEI 225 FUT Dec17	13,56%
Futures ugovori LONG DAX FUT Dec17	13,49%
Obveznice MINISTARSTVO FINACIJA RH XS0464257152	11,70%
Futures ugovori LONG CAC 40 FUT Nov17	11,23%
Obveznice MINISTARSTVO FINACIJA RH HRRHMFO19BA2	10,60%
Futures ugovori SHORT RUSSELL 2000 MINI FUT Dec17	10,54%
Obveznice MINISTARSTVO FINACIJA RH HRRHMFO217A8	10,36%
Futures ugovori SHORT EURO BUND FUT Dec17	6,64%

Valutna izloženost	% NAV	Sektorska izloženost	% VP	Geografska izloženost	% VP
EUR	110,30%	Država	83,78%	Hrvatska	83,78%
USD	5,47%	Trgovina	6,09%	Sjedinjene Američke Države	7,46%
JPY	0,04%	Materijali i sirovine	4,15%	Francuska	4,61%
HRK	-15,81%	Tehnologija	3,39%	Luksemburg	4,15%
		Industrija	2,59%		

Prenosivi vrijednosni papiri % NAV

Uređeno tržište	47,88%
-----------------	--------

Stvarna izloženost (%NAV)

Klasa imovine	Long % NAV	Short % NAV	Ukupna izloženost % NAV
Dionice	53,2	-24,1	77,3
<i>Pojedinačne dionice</i>	10,4	0,0	10,4
<i>Dionički indeksi*</i>	42,8	-24,1	66,9
Državne obveznice i zapisi	53,8	-6,6	60,4
<i>Pojedinačne obveznice i zapisi</i>	53,8	0,0	53,8
<i>Obveznički indeksi*</i>	0,0	-6,6	6,6
Korporativne obveznice	0,0	0,0	0,0
Alternativna ulaganja	0,0	0,0	0,0
<i>Indeksi alternativnih klasa imovine*</i>	0,0	0,0	0,0
Neto novac i novčani ekvivalenti	35,8	0,0	35,8
Ukupno	142,8	-30,7	173,5

**uključuje ulaganja u ETF-ove i futurese*

Geografska i sektorska izloženost iskazuju se za portfelj vrijednosnih papira (%VP).

Prinosi iz prošlosti imaju samo informativni karakter i ne predstavljaju mogućnost ili projekciju mogućeg prinosa u budućnosti. Prinos ne uključuje troškove ulaznih i izlaznih naknada. Kad bi ih uključili, prinos Fonda bio bi niži od navedenog. Prinos se računa kao postotak promjene cijene udjela Fonda u određenom razdoblju. Prosječni godišnji prinos računa se kao geometrijski prosjek prinosa u razdoblju.

Prije ulaganja svaki Ulagatelj dužan je upoznati se s Ključnim informacijama za ulagatelje, Prospektom i Pravilima Fonda. Ključne informacije za ulagatelje Prospekt i Pravila Fonda, te opširnije informacije dostupni su na internet stranici Društva www.rbainvest.hr, na RBA info telefonu 072 62 62 62, te u svim poslovnica RBA.