

Stopy zwrotu strategii asset management

NAZWA FIRMY ASSET MANAGEMENT	NAZWA PORTFELA/STRATEGII	STOPA ZWROTU BRUTTO Z PORTFELA (PROC.)							NAZWA STOSOWANEGO BENCHMARKU	STOPA ZWROTU Z BENCHMARKU (PROC.)		
		styczeń- marzec 2024 r. (kwartałna)	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	kwiecień 2023- marzec 2024 (roczna)	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	trzy- letnia stopa zwrotu	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	pięcio- letnia stopa zwrotu		styczeń- marzec 2024 r. (od początku roku)	kwiecień 2023- marzec 2024 (roczna)	trzy- letnia stopa zwrotu
Portfele akcji polskich												
Quercus TFI	Strategia Akcyjna	11,10	5,64	50,56	9,38	63,64	21,18	122,51	WIG	5,46	41,18	42,46
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia agresywna	7,75	1,49	37,19	1,96	14,25	-22,90	49,67	40 proc. subfundusz Skarbiec Akcja + 40 proc. subfundusz Skarbiec Małych i Średnich Spółek + 20 proc. subfundusz Skarbiec Obligacja. Do końca 2022 r. obowiązywał benchmark: mediana stopy zwrotu funduszy akcji polskich uniwersalnych zgodnie z klasyfikacją funduszy nadaną przez Analizy Online	6,26	35,23	37,15
Dom Maklerski BOŚ	Portfel akcyjny	5,39	3,87	36,49	1,23	39,9	17,13	36,12	WIG20	1,52	35,26	22,77
BM Banku BNP Paribas	Akcji PLN	4,17	-1,42	33,52	-5,59	56,06	24,58	97,56	70 proc. WIG20 + 30 proc. mWIG40	5,59	39,11	31,48
Dom Maklerski BOŚ	Portfel małych i średnich spółek	3,16	-4,25	20,98	-18,28	20,96	-22,21	33,05	mWIG40	7,41	39,26	43,17
mBank Asset Management	Małych i Średnich Spółek PL	6,55	-0,75	20,76	-8,79	42,17	7,21	b.d.	60 proc. mWIG40 + 30 proc. sWIG80 + 10 proc. POLONIA – 1 proc. p.a.	7,30	29,55	34,96
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Akcji Polskich	4,49	-0,37	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	10 proc. w skali roku	4,86	b.d.	b.d.
Portfele akcji rynków zagranicznych												
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia agresywna globalna	13,80	1,65	38,86	3,57	2,74	-25,69	50,88	40 proc. subfundusz Skarbiec Value + 40 proc. subfundusz Skarbiec Spółek Wzrostowych + 10 proc. subfundusz Skarbiec Dłużny Uniwersalny + 10 proc. subfundusz Skarbiec Obligacji Wysokiego Dochodu	12,15	35,29	28,43
Caspar Asset Management	Strategia Spółek Biotechnologicznych i Ochrony Zdrowia	23,14	14,21	19,94	14,66	-47,12	-73,23	b.d.	100 proc. MSCI Daily Total Return World Net Health Care USD (NDWUHC)	8,93	5,28	26,11
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Akcji Globalnych	12,63	2,27	15,46	-0,77	-2,39	-31,16	b.d.	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI)	10,36	16,23	28,77
mBank Asset Management	Akcji Mega Trendy	5,41	-1,51	13,12	-5,66	-11,57	-25,33	b.d.	90 proc. MSCI_EM + 10 proc. POLONIA – 1 proc. p.a.	6,92	18,78	13,76
Caspar Asset Management	Strategia Akcji Spółek Strefy Euro	10,27	1,21	12,07	4,72	-12,65	-31,25	39,76	100 proc. MSCI EMU EUR Net Total Return Index (M7EM)	9,06	7,35	18,60
Michael/Ström Dom Maklerski	Strategia Agresywna	2,17	-0,44	11,69	-7,03	b.d.	b.d.	b.d.	100 proc. średnia funduszy akcji globalnych rynków rozwiniętych	2,61	18,72	b.d.
Caspar Asset Management	Strategia FOCUS Akcyjna	11,44	1,08	11,37	-4,86	6,48	-22,29	107,73	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI)	10,36	16,23	28,77
Caspar Asset Management	Strategia Akcyjna USA	11,49	-0,31	11,20	-9,26	9,67	-25,24	95,99	100 proc. MSCI Daily Total Return USA USD (NDDUUS)	11,80	20,46	34,91
Caspar Asset Management	Strategia SELECT Akcyjna	11,59	1,23	10,50	-5,73	10,11	-18,66	b.d.	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI)	10,36	16,23	28,77
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Globalna ETF	3,60	-4,87	5,60	-6,33	-10,13	-26,99	b.d.	90 proc. MSCI ACWI Index (USD) (MXWD) + 10 proc. stopa referencyjna NBP	8,47	11,93	16,86
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia US Leaders Index	13,39	3,42	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	Nasdaq-100 Index (NDX)	9,97	b.d.	b.d.
Portfele mieszane – zrównoważone (udział akcji od 65 proc.)												
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny PLN	3,45	-0,80	27,30	-4,06	42,65	19,58	78,89	52.5 proc. WIG20 + 22.5 proc. mWIG40 + 25 proc. TBSP.Index	4,25	31,36	23,07
Superfund TFI	Strategia Aktywny Portfel	3,62	1,11	25,03	20,88	31,12	28,09	34,53	60 proc. WIG + 10 proc. WIBID 1M + 10 proc. Bloomberg/EFFAS Bond Indices Poland Govt All > 1Yr TR + 20 proc. Credit Suisse Managed Futures Liquid Index (USD) minus koszty stałe ponoszone w związku z zarządzaniem aktywami, w tym opłata za usługę zarządzania	2,51	4,15	3,03
Superfund TFI	Strategia Aktywna	3,74	-3,40	24,80	26,88	33,30	62,91	35,72	60 proc. WIG + 20 proc. WIBID 1M + 20 proc. Credit Suisse Managed Futures Liquid Index (USD) minus koszty stałe ponoszone w związku z zarządzaniem aktywami, w tym opłata za usługę zarządzania	7,14	-2,08	-29,61
Portfele mieszane aktywów zagranicznych - zrównoważone (udział akcji od 65 proc.)												
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny USD**	4,51	-0,28	12,62	-0,82	12,21	4,15	45,59	10 proc. GS Overnight Money Market USD + 9 proc. Bloomberg Barclays Series-E US Govt All > 1 Yr Bond Index + 6 proc. Bloomberg US Corporate Bond Index + 22 proc. STOXX Europe 600 + 30 proc. S&P 500 + 4 proc. Topix + 19 proc. MSCI EM	4,79	13,44	8,06
mBank Asset Management	Dynamicznego Wzrostu ESG	4,27	-0,69	11,52	-2,94	10,71	3,07	b.d.	65 proc. MSCI ACWI + 25 proc. BB Glob Aggr. TR H-USD + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	4,96	14,46	7,64
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny EUR**	6,18	-0,05	11,27	-1,72	15,93	4,00	41,66	10 proc. EONIA + 9 proc. Bloomberg Barclays Series-E Euro Govt All > 1 Yr Bond Index + 6 proc. FTSE Euro Corporate AA Index + 30 proc. STOXX Europe 600 + 22 proc. S&P500 + 4 proc. Topix + 19 proc. MSCI EM	6,23	12,99	11,93
Portfele mieszane - zrównoważone (udział akcji od 40 do 65 proc.)												
Dom Maklerski BOŚ	Portfel IKE/IKZE Dynamika	3,35	0,72	30,54	4,93	26,56	-2,93	29,58	60 proc. WIG + 40 proc. WIBID 6M	2,63	25,61	29,49
Skarbiec TFI	Portfel funduszy - strategia zrównoważona	4,86	0,75	25,21	1,22	8,17	-10,35	30,96	25 proc. subfundusz Skarbiec Akcja + 25 proc. subfundusz Skarbiec Małych i Średnich Spółek + 25 proc. subfundusz Skarbiec Obligacja + 25 proc. subfundusz Skarbiec Konserwatywny. Do końca 2022 r. obowiązywał benchmark: mediana stopy zwrotu funduszy mieszanych polskich zrównoważonych zgodnie z klasyfikacją funduszy nadaną przez Analizy Online	4,11	23,99	18,52
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Równowaga/Zrównoważony	1,56	0,11	22,45	1,70	29,62	11,31	40,43	50 proc. WIG20 + 50 proc. WIBID 6M	1,45	20,75	18,31
Dom Maklerski BOŚ	Portfel IKE/IKZE Równowaga	2,61	0,40	22,15	3,00	18,85	-5,49	25,26	40 proc. WIG + 60 proc. WIBID 6M	2,21	19,15	24,34
BM Banku BNP Paribas	Zrównoważony PLN	2,41	-0,50	20,72	-2,89	27,74	13,08	53,12	35 proc. WIG20 + 15 proc. mWIG40 + 50 proc. TBSP.Index	2,91	23,61	14,66
Superfund TFI	Strategia Zrównoważony Portfel	2,27	-0,32	14,98	10,07	20,38	14,19	25,82	30 proc. WIG + 30 proc. WIBID 1M + 20 proc. Bloomberg/EFFAS Bond Indices Poland Govt All > 1Yr TR + 20 proc. Credit Suisse ponoszone w związku z zarządzaniem aktywami, w tym opłata za usługę zarządzania	2,59	4,91	6,19
Superfund TFI	Strategia Zrównoważona	2,53	-1,89	14,55	11,28	24,31	41,72	27,97	30 proc. WIG + 50 proc. WIBID 1M + 20 proc. Credit Suisse Managed Futures Liquid Index (USD) minus koszty stałe ponoszone w związku z zarządzaniem aktywami, w tym opłata za usługę zarządzania	4,42	3,27	-17,41
Portfele mieszane aktywów zagranicznych – zrównoważone (udział akcji od 40 do 65 proc.)												
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia zrównoważona globalna	8,42	0,82	26,30	1,63	0,79	-24,03	31,76	25 proc. subfundusz Skarbiec Value + 25 proc. subfundusz Skarbiec Spółek Wzrostowych + 25 proc. subfundusz Skarbiec Dłużny Uniwersalny + 25 proc. subfundusz Skarbiec Obligacji Wysokiego Dochodu. Do końca 2022 r. obowiązywał benchmark: 40 proc. mediana stopy zwrotu funduszy akcji globalnych rynków rozwiniętych + 60 proc. mediana stopy zwrotu funduszy dłużnych polskich papierów skarbowych zgodnie z klasyfikacją funduszy nadaną przez Analizy Online.	7,6	24,67	24,82
mBank Asset Management	Zrównoważona ESG	2,79	-0,61	10,59	-0,46	11,43	6,64	b.d.	45 proc. MSCI ACWI + 45 proc. BB Global Aggreg. TR H-USD + 10 proc. POLONIA – 1 proc. p.a.	3,40	11,05	4,79
BM Banku BNP Paribas	Zrównoważony USD**	3,02	0,05	9,10	-0,52	5,60	1,91	28,23	10 proc. GS Overnight Money Market USD + 22 proc. Bloomberg Barclays Series-E US Govt All > 1 Yr Bond Index + 18 proc. Bloomberg US Corporate Bond Index + 15 proc. STOXX Europe 600 + 20 proc. S&P500 + 2 proc. Topix + 13 proc. MSCI EM	2,97	9,62	3,69
BM Banku BNP Paribas	Zrównoważony EUR**	4,15	0,07	8,92	-1,40	8,56	4,00	24,07	10 proc. EONIA + 22proc. Bloomberg Barclays Series-E Euro Govt All > 1 Yr Bond Index + 18 proc. FTSE Euro Corporate AA Index+ 20 proc. STOXX Europe 600 + 15 proc. S&P 500 + 2 proc. Topix + 13 proc. MSCI EM]	4,08	10,32	4,56