

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.)		
		październik- grudzień 2023 r. (kwarta- lna)	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	styczeń- grudzień 2023 (roczna)	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	trzy- letnia stopa zwrotu	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	pięcio- letnia stopa zwrotu		październik- grudzień 2023 r. (kwarta- lna)	styczeń- grudzień 2023 (roczna)	trzy- letnia stopa zwrotu
Portfele akcji polskich												
Quercus TFI	Strategia Akcyjna	19,48	-0,49	47,28	10,74	77,81	40,22	121,84	WIG	19,97	36,54	37,59
BM Banku BNP Paribas	Akcji PLN	18,53	-2,25	40,53	7,23	69,55	43,24	b.d.	70 proc. WIG20 + 30 proc. mWIG40	20,78	33,3	26,31
Dom Maklerski BOŚ	Portfel akcyjny	19,6	-5,05	35,41	4,29	38,00	21,29	34,14	WIG20	24,65	31,12	16,71
Skarbiec TFI	Portfel funduszy - strategia agresywna	14,31	0,00	32,03	-1,03	5,90	-26,91	52,74	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	14,31	33,06	32,81
mBank Asset Management	Małych i Średnich Spółek PL	7,74	-5,75	30,66	-1,77	53,48	14,76	b.d.	60 proc. mWIG40 + 30 proc. sWIG80 + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	13,49	32,43	38,72
Dom Maklerski BOŚ	Portfel małych i średnich spółek	13,09	-6,76	30,61	-11,02	22,67	-23,51	40,41	mWIG40	19,85	41,63	46,18
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Akcji Polskich 2	17,91	15,48	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	10 proc. w skali roku	2,43	b.d.	b.d.
Portfele akcji rynków zagranicznych												
Skarbiec TFI	Portfel funduszy - strategia agresywna globalna	12,84	0,79	24,22	0,35	-12,28	-30,19	52,40	40 proc. subfundusz Skarbiec Value + 40 proc. subfundusz Skarbiec Spółek Wzrostowych + 10 proc. subfundusz Skarbiec Dłużny Uniwersalny + 10 proc. subfundusz Skarbiec Obligacji Wysokiego Dochodu	12,05	23,87	17,91
mBank Asset Management	Akcyjna Mega Trendy	9,56	-0,05	16,84	-1,05	-13,48	-23,66	b.d.	90 proc. MSCI_EM + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	9,61	17,89	10,18
Michael/Ström Dom Maklerski	Strategia Agresywna	8,18	-0,76	11,50	-7,34	b.d.	b.d.	b.d.	100 proc. średnia funduszy akcji globalnych rynków rozwiniętych	8,94	18,84	b.d.
Caspar Asset Management	Strategia Akcji Spółek Strefy Euro	0,02	-1,05	5,83	-4,29	-17,99	-37,65	47,28	100 proc. MSCI EMU EUR Net Total Return Index (M7EM)	1,07	10,12	19,66
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Akcji Globalnych	-6,38	-6,71	2,19	-8,47	-10,06	-39,30	b.d.	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI)	0,33	10,66	29,24
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Globalna ETF	-6,02	-5,87	0,63	-6,64	-9,64	-27,06	b.d.	90 proc. MSCI ACWI Index (USD) (MXWD) + 10 proc. stopa referencyjna NBP	-0,15	7,27	17,42
Caspar Asset Management	Strategia Akcyjna USA	-6,65	-7,34	-1,55	-14,63	1,06	-33,17	120,42	100 proc. MSCI Daily Total Return USA USD (NDDUUS)	0,69	13,08	34,23
Caspar Asset Management	Strategia FOCUS Akcyjna	-5,80	-6,13	-1,57	-12,23	-1,11	-30,35	131,69	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI)	0,33	10,66	29,24
Caspar Asset Management	Strategia SELECT Akcyjna	-5,79	-6,12	-2,82	-13,48	1,07	-28,17	b.d.	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI)	0,33	10,66	29,24
Caspar Asset Management	Strategia Spółek Biotechnologicznych i Ochrony Zdrowia	2,91	7,57	-8,93	-1,68	-55,92	-79,02	b.d.	100 proc. MSCI Daily Total Return World Net Health Care USD (NDWUHC)	-4,66	-7,25	23,10
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia US Leaders Index	4,20	1,23	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	Nasdaq-100 Index (NDX)	2,97	b.d.	b.d.
Portfele mieszane – zrównoważone (udział akcji od 65 proc.)												
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny PLN	14,35	-1,89	33,69	5,52	43,23	24,32	60,05	52.5 proc. WIG20 + 22.5 proc. mWIG40 + 25 proc. TBSP.Index	16,24	28,17	18,91
Superfund TFI	Strategia Aktywna	11,71	7,21	23,55	45,24	31,91	65,74	32,87	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	4,5	-21,69	-33,83
Superfund TFI	Strategia Aktywny Portfel	11,86	1,35	21,93	10,24	29,79	27,69	31,90	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	10,51	11,69	2,1
Portfele mieszane aktywów zagranicznych – zrównoważone (udział akcji od 65 proc.)												
mBank Asset Management	Dynamicznego Wzrostu ESG	7,38	-1,07	13,41	-1,25	10,29	5,61	b.d.	65 proc. MSCI ACWI + 25 proc. BB Glob Aggr. TR H-USD + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	8,45	14,66	4,68
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny USD	7,57	-1,17	13,18	-1,24	10,72	5,21	43,76	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	8,74	14,42	5,51
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny EUR	3,27	-1,96	8,56	-2,77	17,47	6,09	36,98	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	5,23	11,33	11,38
Portfele mieszane – zrównoważone (udział akcji od 40 do 65 proc.)												
Dom Maklerski BOŚ	Portfel IKE/IKZE Dynamika	16,34	2,69	28,19	3,04	25,83	-1,21	29,83	60 proc. WIG + 40 proc. WIBID 6M	13,65	25,15	27,04
BM Banku BNP Paribas	Zrównoważony PLN	10,34	-1,36	26,82	3,77	27,75	16,25	45,21	35 proc. WIG20 + 15 proc. mWIG40 + 50 proc. TBSP.Index	11,7	23,05	11,5
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Zrównoważony	14,70	1,70	25,49	6,62	30,74	16,14	43,30	50 proc. WIG20 + 50 proc. WIBID 6M	13	18,87	14,6
Skarbiec TFI	Portfel funduszy - strategia zrównoważona	10,08	0,26	23,19	-0,59	2,62	-13,43	32,75	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	9,82	23,78	16,05
Dom Maklerski BOŚ	Portfel IKE/IKZE Równowaga	11,58	2,02	21,92	2,95	18,45	-3,74	25,37	40 proc. WIG + 60 proc. WIBID 6M	9,56	18,97	22,19
Superfund TFI	Strategia Zrównoważony Portfel	6,48	-1,44	13,84	3,17	19,95	15,05	23,86	30 proc. WIG + 30 proc. WIBID 1M + 20 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	7,92	10,67	4,9
Superfund TFI	Strategia Zrównoważona	6,20	2,45	12,46	22,54	23,79	44,27	25,60	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	3,75	-10,08	-20,48
Portfele mieszane aktywów zagranicznych – zrównoważone (udział akcji od 40 do 65 proc.)												
Skarbiec TFI	Portfel funduszy - strategia zrównoważona globalna	9,21	0,11	19,32	-0,05	-8,85	-26,33	31,83	5 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	9,1	19,37	17,48
mBank Asset Management	Zrównoważona ESG	6,17	-1,34	11,76	-0,32	9,00	7,11	b.d.	45 proc. MSCI ACWI + 45 proc. BB Global Aggr. TR H-USD + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	7,51	12,08	1,89
BM Banku BNP Paribas	Zrównoważony USD	7,15	-0,84	10,38	-1,23	3,30	2,40	26,91	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	7,99	11,61	0,9
Michael/Ström Dom Maklerski	Strategia Zrównoważona	7,57	0,63	9,54	-3,43	b.d.	b.d.	b.d.	50 proc. średnia funduszy papierów dłużnych globalnych uniwersalnych + 50 proc. średnia funduszy akcji globalnych rynków rozwiniętych	6,94	12,97	b.d.