

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.)		
		lipiec- wrzesień 2023 r. (kwartałna)	styczeń- wrzesień 2023 r. (od początku roku)	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	październik 2022- wrzesień 2023 (roczna)	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	trzy- letnia stopa zwrotu	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	pięcio- letnia stopa zwrotu	styczeń- wrzesień 2023 r. (od początku roku)		październik 2022- wrzesień 2023 (roczna)	trzy- letnia stopa zwrotu	
Portfele akcji polskich														
BM Banku BNP Paribas	Akcji PLN	-3,40	18,56	8,08	51,65	12,65	56,01	36,14	43,05	70 proc. WIG20 + 30 proc. mWIG40	10,48	39	19,87	
Quercus TFI	Strategia Akcyjna	1,68	24,41	10,60	43,58	1,32	79,37	47,02	87,01	WIG	13,81	42,26	32,35	
Dom Maklerski BOŚ	Portfel akcyjny	-2,28	13,22	8,03	36,01	-0,01	28,09	17,71	8,23	WIG20	5,19	36,02	10,38	
mBank Asset Management	Małych i Średnich Spółek PL	-2,47	21,28	4,59	35,20	3,25	60,51	25,07	b.d.	60 proc. mWIG40 + 30 proc. sWIG80 + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	16,69	31,95	35,44	
Dom Maklerski BOŚ	Portfel małych i średnich spółek	-1,09	15,49	-2,69	29,58	-9,72	16,77	-20,54	10,68	mWIG40	18,18	39,3	37,31	
Skarbiec TFI	Portfel funduszy - strategia agresywna	-1,69	15,70	-1,06	23,63	-17,38	-0,70	-31,42	18,94	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.	16,76	41,01	30,72	
Portfele akcji rynków zagranicznych														
Caspar Asset Management	Strategia Akcji Spółek Strefy Euro	5,50	5,81	-3,15	11,42	-6,86	-4,07	-40,14	23,19	100 proc. MSCI EMU EUR Net Total Return Index (M7EM)	8,96	18,28	36,07	
mBank Asset Management	Akcyjna Mega Trendy	-6,00	6,64	-0,92	10,45	-6,17	0,26	-13,52	b.d.	90 proc. MSCI_EM + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	7,56	16,62	13,78	
Skarbiec TFI	Portfel funduszy - strategia agresywna globalna	-5,13	10,27	-0,74	9,11	-9,61	-15,22	-30,97	15,03	40 proc. subfundusz Skarbiec Value + 40 proc. subfundusz Skarbiec Spółek Wzrostowych + 10 proc. subfundusz Skarbiec Dłużny Uniwersalny + 10 proc. subfundusz Skarbiec Obligacji Wysokiego Dochodu.	11,01	18,72	15,75	
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Globalna ETF	8,99	7,07	-0,37	2,93	-1,99	5,56	-23,87	b.d.	90 proc. MSCI ACWI Index (USD) (MXWD) + 10 proc. stopa referencyjna NBP	7,44	4,92	29,43	
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Akcji Globalnych	9,58	9,16	-1,13	2,15	-5,44	20,74	-21,98	b.d.	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI)	10,29	7,59	42,72	
Caspar Asset Management	Strategia Akcyjna USA	6,37	5,46	-6,85	0,28	-6,49	36,20	-10,28	105,11	100 proc. MSCI Daily Total Return USA USD (NDDUUS)	12,31	6,77	46,48	
Caspar Asset Management	Strategia SELECT Akcyjna	6,37	3,15	-7,14	-2,10	-9,69	31,76	-10,96	b.d.	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI)	10,29	7,59	42,72	
Caspar Asset Management	Strategia FOCUS Akcyjna	6,64	4,48	-5,81	-2,56	-10,15	28,82	-13,90	113,79	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI)	10,29	7,59	42,72	
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Absolutnej Stopy Zwrotu Wysokiego Ryzyka	6,51	-6,00	-7,78	-17,40	-16,39	-3,14	-18,29	-9,27	Stopa zwrotu wyrażona w Euro wynosząca 4 proc. w skali roku	1,78	-1,01	15,15	
Caspar Asset Management	Strategia Spółek Biotechnologicznych i Ochrony Zdrowia	-13,91	-11,51	-8,80	-30,26	-28,08	-40,01	-74,12	b.d.	100 proc. MSCI Daily Total Return World Net Health Care USD (NDWUHC)	-2,71	-2,18	34,11	
Michael/Ström Dom Maklerski	Strategia Agresywna	-4,33	3,07	-6,02	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	100 proc. Średnia funduszy akcji globalnych rynków rozwiniętych	9,09	b.d.	b.d.	
Portfele mieszane - zrównoważone (udział akcji od 65 proc.)														
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny PLN	-1,85	16,91	6,57	40,41	7,70	41,70	28,08	39,96	52.5 proc. WIG20 + 22.5 proc. mWIG40 + 25 proc. TBSP.Index	10,34	32,71	13,62	
Superfund TFI	Strategia Aktywny Portfel	-1,63	9,00	7,94	24,45	12,79	28,88	33,53	17,63	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	1,06	11,66	-4,65	
Superfund TFI	Strategia Aktywna	-1,71	8,50	33,56	23,55	46,28	31,06	66,55	18,43	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	-25,06	-22,73	-35,49	
Portfele mieszane aktywów zagranicznych - zrównoważone (udział akcji od 65 proc.)														
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny USD	-2,44	5,21	-0,01	15,65	0,70	16,13	8,34	33,64	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	5,22	14,95	7,79	
mBank Asset Management	Dynamicznego Wzrostu ESG	-3,28	5,61	-0,12	10,19	-2,26	2,71	-2,80	b.d.	65 proc. MSCI ACWI + 25 proc. BB Glob Aggr. TR H-USD + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	5,73	12,45	5,51	
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny EUR	-0,02	5,12	-0,68	7,74	-0,84	23,94	9,57	32,64	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	5,80	8,58	14,37	
Portfele mieszane - zrównoważone (udział akcji od 40 do 65 proc.)														
BM Banku BNP Paribas	Zrównoważony PLN	-0,47	14,94	4,74	31,65	5,23	26,22	18,85	31,60	35 proc. WIG20 + 15 proc. mWIG40 + 50 proc. TBSP.Index	10,2	26,42	7,37	
Dom Maklerski BOŚ	Portfel IKE/IKZE Dynamika	0,03	10,19	0,41	28,00	1,11	22,51	-0,65	8,76	60 proc. WIG + 40 proc. WIBID 6M	9,78	26,89	23,16	
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Zrównoważony	-2,13	9,41	4,22	24,70	3,15	25,79	15,09	21,52	50 proc. WIG20 + 50 proc. WIBID 6M	5,19	21,55	10,7	
Dom Maklerski BOŚ	Portfel IKE/IKZE Równowaga	0,62	9,27	1,02	20,90	0,66	15,62	-3,48	10,20	40 proc. WIG + 60 proc. WIBID 6M	8,25	20,24	19,1	
Skarbiec TFI	Portfel funduszy - strategia zrównoważona	-0,68	12,01	-0,80	18,05	-9,14	-1,81	-16,82	12,63	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.	12,81	27,19	15,01	
Superfund TFI	Strategia Zrównoważony Portfel	-0,23	6,91	4,36	14,92	3,87	19,90	20,17	17,15	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	2,55	11,05	-0,27	
Superfund TFI	Strategia Zrównoważona	-0,40	5,90	19,23	13,22	23,70	23,90	45,88	18,66	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	-13,33	-10,48	-21,98	
Portfele mieszane aktywów zagranicznych - zrównoważone (udział akcji od 40 do 65 proc.)														
mBank Asset Management	Zrównoważona ESG	-2,21	5,26	1,01	10,64	1,55	11,14	9,80	b.d.	45 proc. MSCI ACWI + 45 proc. BB Global Aggr. TR H-USD + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	4,25	9,09	1,34	
BM Banku BNP Paribas	Zrównoważony USD	-2,47	3,02	-0,34	10,55	0,15	4,77	4,19	18,44	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	3,36	10,4	0,58	
Skarbiec TFI	Portfel funduszy - strategia zrównoważona globalna	-2,74	9,34	-0,19	9,24	-4,86	-10,76	-22,92	10,46	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.	9,53	14,1	12,16	
mBank Asset Management	Portfel Funduszy Zrównoważony Odpowiedzialnego Inwestowania*	-2,90	2,59	21579,11	6,77	-0,02	b.d.	b.d.	b.d.	45 proc. MSCI ACWI + 45 proc. BB Glob Aggr + 10 proc. POLONIA - 1.95 proc. p.a.	2,89	6,79	b.d.	