

NAZWA FIRMY ASSET MANAGEMENT	NAZWA PORTFELA/STRATEGII	STOPA ZWROTU BRUTTO Z PORTFELA (PROC.)							NAZWA STOSOWANEGO BENCHMARKU	STOPA ZWROTU Z BENCHMARKU (PROC.)		
		styczeń- marzec 2023 r. (kwarta- lna)	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	kwiecień 2022- marzec 2023 (roczna)	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	trzy- letnia stopa zwrotu	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	pięcio- letnia stopa zwrotu		styczeń- marzec 2023 r. (od początku roku)	kwiecień 2022- marzec 2023 (roczna)	trzy- letnia stopa zwrotu
Caspar Asset Management	Strategia Focus Zrównoważona (d. Strategia Zrównoważona Akcji Skoncentrowanych)	0,48	-3,26	-8,73	-8,93	31,78	-8,36	b.d.	60 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI) + 40 proc. WIBOR 6M	3,74	0,20	40,14
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia zrównoważona globalna	5,69	-0,31	-12,69	-15,74	8,14	-8,68	b.d.	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	6,00	3,05	16,82
Portfele mieszane – stabilnego wzrostu (udział akcji do 40 proc.)												
Superfund TFI	Strategia Konserwatywna	1,42	0,73	5,60	5,73	10,41	7,18	9,85	5 proc. WIG + 90 proc. WIBID 1M + 5 proc. Credit Suisse Managed Futures Liquid Index (USD) minus koszty stałe ponoszone w związku z zarządzaniem aktywami, w tym opłata za usługę zarządzania	0,69	-0,13	3,23
Superfund TFI	Strategia Konserwatywny Portfel	2,33	-1,99	5,12	0,29	5,49	-9,94	6,47	5 proc. WIG + 60 proc. WIBID 1M + 30 proc. Bloomberg/EFFAS Bond Indices Poland Govt All > 1Yr TR + 5 proc. Credit Suisse Managed Futures Liquid Index (USD) minus koszty stałe ponoszone w związku z zarządzaniem aktywami, w tym opłata za usługę zarządzania	4,32	4,83	15,43
BM Banku BNP Paribas	Stabilny PLN	6,48	2,67	4,59	4,57	15,08	12,80	15,40	17,5 proc. WIG20 + 7,5 proc. mWIG40 + 75 proc. TBSP.Index	3,81	0,02	2,28
mBank Asset Management	Dochodowa 2.0	3,23	0,02	2,66	3,76	8,85	8,88	7,52	40 proc. BB Glob Aggr + 35 proc. BB Pol Govt + 10 proc. MSCI ACWI + 5 proc. WIG + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	3,21	-1,10	-0,03
mBank Asset Management	Portfel Funduszy Stabilnego Wzrostu*	4,38	4,07	2,55	4,98	13,28	0,52	8,82	20 proc. WIG20 + 20 proc. WIBID ON + 5 proc. MSCI ACWI + 55 proc. Bloomberg/EFFAS Bonds Indices, Poland Govt All > 1 Yr	0,31	-2,43	12,76
Dom Maklerski BOŚ	Portfel IKE/IKZE Dekada	2,62	0,69	-0,80	-3,96	8,04	-6,81	4,79	20 proc. WIG + 80 proc. WIBID 6M	1,93	3,16	14,85
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia dochodowa	3,78	-0,26	-2,00	-2,07	7,33	-1,21	7,28	10 proc. subfundusz Skarbiec Akcja + 10 proc. subfundusz Skarbiec Małych i Średnich Spółek + 40 proc. subfundusz Skarbiec Obligacji + 40 proc. subfundusz Skarbiec Krótkoterminowy. Do końca 2022 r. obowiązywał benchmark: mediana stopy zwrotu funduszy mieszanych polskich stabilnego wzrostu zgodnie z klasyfikacją funduszy nadaną przez Analizy Online	4,04	0,07	8,54
mBank Asset Management	Antyinflacyjna	1,88	0,22	-3,15	1,54	b.d.	-	b.d.	65 proc. BB World Govt Infl. 1-5 + 10 proc. MSCI World Value + 10 proc. FTSE Global REIT + 10 proc. BB Commodity Index + 5 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	1,66	-4,69	b.d.
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Stabilnego Wzrostu	2,23	1,49	-3,69	-2,74	8,74	-2,32	2,65	30 proc. WIG20 + 70 proc. WIBID 6M	0,74	-0,95	11,06
Portfele mieszane aktywów zagranicznych – stabilnego wzrostu (udział akcji do 40 proc.)												
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Stabilnego Wzrostu Globalna ETF + Obligacje	1,99	-0,45	1,32	-1,11	10,86	-9,12	b.d.	30 proc. MSCI ACWI Index (USD) (MXWD) + 70 proc. stopa referencyjna NBP	2,44	2,43	19,98
Caspar Asset Management	Strategia Focus Stabilnego Wzrostu (d. Strategia Stabilnego Wzrostu Akcji Skoncentrowanych)	1,66	-1,09	-5,06	-8,74	12,93	-11,10	b.d.	30 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI) + 70 proc. WIBOR 6M	2,75	3,68	24,03
BM Banku BNP Paribas	Stabilny USD	3,81	-0,13	-5,30	-0,93	7,78	3,51	8,11	10 proc. GS Overnight Money Market USD + 43 proc. Bloomberg Barclays Series-E US Govt All > 1 Yr Bond Index + 22 proc. Bloomberg US Corporate Bond Index + 8 proc. STOXX Europe 600 + 10 proc. S&P500 + 1 proc. Topix + 6 proc. MSCI EM	3,94	-4,37	4,27
BM Banku BNP Paribas	Stabilny EUR	2,45	-0,49	-6,75	0,92	8,30	7,07	6,00	10 proc. EONIA + 43 proc. Bloomberg Barclays Series-E Euro Govt All > 1 Yr Bond Index + 22 proc. FTSE Euro Corporate AA Index + 10 proc. STOXX Europe 600 + 8 proc. S&P500 + 1 proc. Topix + 6 proc. MSCI EM	2,94	-7,67	1,23
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Stabilnego Wzrostu Risk Parity	0,81	-0,39	-6,78	-8,74	21,10	-6,97	b.d.	40 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI) + 60 proc. Federal Funds Target Rate – Lower Bound (FDTRFTRL)	1,20	1,96	28,07
Portfele o zmiennej alokacji aktywów												
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny Aktywnej Alokacji PLN	7,59	4,62	8,37	12,94	b.d.	b.d.	b.d.	35 proc. WIG20 + 15 proc. mWIG40 + 50 proc. TBSP.Index	2,97	-4,57	b.d.
BM Banku BNP Paribas	Zrównoważony Aktywnej Alokacji PLN	7,04	3,73	7,29	10,01	b.d.	b.d.	b.d.	28 proc. WIG20 + 12 proc. mWIG40 + 60 proc. TBSP.Index	3,31	-2,72	b.d.
Superfund TFI	Strategia PRP Portfel Absolutnej stopy zwrotu (brutto)	1,68	-4,73	6,43	12,23	7,37	0,72	8,93	WIBID 1M	6,41	-5,80	6,65
BM Banku BNP Paribas	Stabilny Aktywnej Alokacji PLN	6,26	2,29	5,73	4,81	b.d.	b.d.	b.d.	14 proc. WIG20 + 6 proc. mWIG40 + 80 proc. TBSP.Index	3,97	0,92	b.d.
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Zysk Absolutny	8,08	6,35	-1,30	-7,99	45,79	38,12	11,76	WIBID 6M	1,73	6,69	7,67
mBank Asset Management	MultiAsset	1,52	-1,80	-2,17	-0,62	21,47	2,70	13,83	40 proc. (POLONIA + 2,5 proc.) + 15 proc. WIG + 25 proc. MSCI ACWI + 20 proc. BB Glob Aggr - 1 proc. p.a.	3,32	-1,55	18,77
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Aktywnej Alokacji	5,67	3,94	-2,81	-9,50	41,68	34,01	0,68	WIBID 6M	1,73	6,69	7,67
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia absolute return	3,01	3,01	-3,53	-11,08	6,47	-8,83	b.d.	0 pkt proc. Do końca 2022 r. obowiązywał benchmark: WIBOR 12M + 250 pkt baz.	0,00	7,55	15,30
Portfele dłużne oraz rynku pieniężnego												
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Polskich Obligacji Skarbowych 01	3,35	1,67	10,81	4,49	b.d.	b.d.	b.d.	Stopa referencyjna NBP	1,68	6,32	b.d.
Quercus TFI	Strategia Dłużna Krótkoterminowa	3,06	1,33	9,55	2,57	b.d.	b.d.	b.d.	WIBID3M + 30 pkt. bazowych	1,73	6,98	b.d.
mBank Asset Management	Portfel Funduszy Konserwatywny*	3,58	3,29	5,33	4,20	3,90	0,04	7,45	WIBID O/N 20 proc. Bloomberg/EFFAS Bonds Indices, Poland Govt All > 1 Yr 80 proc.	0,29	1,13	3,86
BM Banku BNP Paribas	Konserwatywny PLN	5,33	0,74	3,89	-0,59	-3,52	3,54	4,24	TBSP Indeks	4,59	4,48	-7,06
mBank Asset Management	Ochrony Kapitału	2,96	-0,20	3,44	0,43	-0,78	4,45	5,19	20 proc. BB Glob Aggr + 70 proc. BB Pol Govt + 10 proc. POLONIA - 0,8 proc. p.a.	3,16	3,01	-5,23
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia płynnościowa	2,72	0,44	3,43	-1,78	-0,18	-3,77	1,77	50 proc. subfundusz Skarbiec Konserwatywny + 50 proc. subfundusz Skarbiec Krótkoterminowy. Do końca 2022 r. obowiązywał benchmark: mediana stopy zwrotu funduszy dłużnych polskich papierów skarbowych zgodnie z klasyfikacją funduszy nadaną przez Analizy Online.	2,28	5,21	3,59
Dom Maklerski BOŚ	Portfel IKE/IKZE Ochrona	2,92	1,19	2,53	-4,16	-1,68	-9,35	6,35	WIBID 6M	1,73	6,69	7,67
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Bezpieczny	4,59	2,86	0,29	-6,40	-16,44	-24,11	-7,31	WIBID 6M	1,73	6,69	7,67
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Polskich Obligacji Skarbowych 02	1,46	-0,22	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	Stopa referencyjna NBP	1,68	b.d.	b.d.
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Indywidualna Obligacji	3,69	2,01	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	Stopa referencyjna NBP	1,68	b.d.	b.d.
Portfele alternatywne												
Superfund TFI	Strategia Managed Futures	-4,04	10,89	3,22	39,38	30,18	59,37	26,20	Credit Suisse Managed Futures Liquid Index (USD) minus koszty stałe ponoszone w związku z zarządzaniem aktywami, w tym opłata za usługę zarządzania	-14,93	-36,16	-29,19

* wyniki netto. Źródło: spółki. Sortowanie wg rocznej stopy zwrotu.