

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 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
Portfele akcji												
mBank Asset Management	Małych i Średnich Spółek PL	15,28	5,60	13,87	16,55	91,90	32,07	b.d.	60 proc. mWIG40 + 30 proc. sWIG80 + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	9,68	-2,68	59,83
BM Banku BNP Paribas	Akcji PLN	9,65	8,50	3,36	17,33	83,58	55,28	40,95	70 proc. WIG20 + 30 proc. mWIG40	1,15	-13,97	28,30
Quercus TFI	Strategia Akcyjna	8,33	6,34	0,47	10,16	98,51	57,71	21,88	WIG	1,99	-9,69	40,80
Dom Maklerski BOŚ	Portfel małych i średnich spółek	11,36	2,12	0,46	6,59	30,95	-27,48	4,61	mWIG40	9,24	-6,13	58,43
Dom Maklerski BOŚ	Portfel akcyjny	4,56	6,15	-6,69	12,07	30,93	11,96	3,76	WIG20	-1,59	-18,76	18,97
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Akcji Polskich	-0,23	3,20	-9,19	8,78	b.d.	b.d.	b.d.	MSCI Poland Total Return Index	-3,43	-17,97	b.d.
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia agresywna	6,37	-0,84	-10,90	-5,78	17,61	-24,70	13,49	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	7,21	-5,12	42,31
Portfele akcji rynków zagranicznych												
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Absolutnej Stopy Zwrotu Wysokiego Ryzyka	-5,92	-6,58	-7,42	-11,92	-21,03	-36,52	-0,75	Stopa zwrotu wyrażona w Euro wynosząca 4 proc. w skali roku	0,66	4,50	15,49
Caspar Asset Management	Strategia Akcji Spółek Strefy Euro	4,13	-7,74	-7,56	-16,24	12,96	-49,86	22,70	100 proc. MSCI EMU EUR Net Total Return Index (M7EM)	11,87	8,68	62,82
mBank Asset Management	Akcyjna Mega Trendy	8,88	2,76	-11,01	-2,77	72,31	32,18	b.d.	90 proc. MSCI_EM + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	6,12	-8,24	40,13
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Globalna ETF	-1,27	-5,22	-11,28	-5,93	11,54	-35,18	b.d.	90 proc. MSCI ACWI Index (USD) (MXWD) + 10 proc. stopa referencyjna NBP	3,95	-5,35	46,72
Caspar Asset Management	Strategia Akcyjna USA	-1,29	-6,23	-12,76	-6,30	49,42	-20,49	148,24	100 proc. MSCI Daily Total Return USA USD (NDDUS)	4,94	-6,46	69,91
Caspar Asset Management	Strategia Select Akcyjna (d. Specjalistyczna Strategia Akcyjna Selektowna)	-1,86	-6,94	-13,23	-8,73	52,88	-10,41	b.d.	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI)	5,08	-4,50	63,29
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Akcji Globalnych	-0,31	-5,39	-13,41	-8,91	38,71	-24,58	b.d.	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI)	5,08	-4,50	63,29
Caspar Asset Management	Strategia Focus Akcyjna	-1,51	-6,59	-14,40	-9,90	51,50	-11,79	137,52	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI)	5,08	-4,50	63,29
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia agresywna globalna	6,85	-0,44	-18,25	-13,57	13,04	-18,66	b.d.	40 proc. subfundusz Skarbiec Value + 40 proc. subfundusz Skarbiec Spółek Wzrostowych + 10 proc. subfundusz Skarbiec Dłużny Uniwersalny + 10 proc. subfundusz Skarbiec Obligacji Wysokiego Dochodu	7,29	-4,68	31,70
Caspar Asset Management	Strategia Spółek Biotechnologicznych i Ochrony Zdrowia (d. Specjalistyczna Strategia Spółek Biotechnologicznych i Ochrony Zdrowia)	-6,50	-2,48	-36,89	-35,81	-13,31	-61,36	b.d.	Do końca 2022 r. obowiązywał benchmark: mediana stopy zwrotu funduszy akcji globalnych rynków rozwiniętych zgodnie z klasyfikacją funduszy nadaną przez Analizy Online.	-4,02	-1,08	48,05
Portfele mieszane – zrównoważone (udział akcji od 65 proc.)												
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny PLN	8,65	6,56	6,09	15,33	58,65	38,47	36,45	52,5 proc. WIG20 + 22,5 proc. mWIG40 + 25 proc. TBSP.Index	2,09	-9,24	20,18
Superfund TFI	Strategia Aktywna	0,75	15,06	-3,08	31,90	34,38	64,81	8,75	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	-14,31	-34,98	-30,43
Superfund TFI	Strategia Aktywny Portfel	1,05	-8,56	-3,29	4,96	32,29	6,88	7,60	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	9,61	-8,25	25,41
Portfele mieszane aktywów zagranicznych – zrównoważone (udział akcji od 65 proc.)												
mBank Asset Management	Dynamicznego Wzrostu ESG	6,04	0,90	-3,85	4,23	b.d.	-	b.d.	65 proc. MSCI ACWI + 25 proc. BB Glob Aggr. TR H-USD + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	5,14	-8,08	b.d.
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny EUR	3,60	-1,07	-5,55	-0,95	44,23	15,22	30,01	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	4,67	-4,60	29,01
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny USD	5,02	-0,68	-6,35	-0,75	45,12	15,04	23,87	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	5,70	-5,60	30,08
Portfele mieszane – zrównoważone (udział akcji od 40 do 65 proc.)												
BM Banku BNP Paribas	Zrównoważony PLN	7,59	4,62	5,04	9,61	35,81	24,38	25,81	35 proc. WIG20 + 15 proc. mWIG40 + 50 proc. TBSP.Index	2,97	-4,57	11,43
Superfund TFI	Strategia Zrównoważona	0,66	10,58	1,59	28,34	23,53	45,24	11,72	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	-9,92	-26,75	-21,71
Superfund TFI	Strategia Zrównoważony Portfel	1,26	-6,66	1,24	5,65	19,81	-2,76	9,42	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	-4,41	22,57
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Zrównoważony	4,08	4,01	-0,56	5,47	33,73	20,41	16,37	50 proc. WIG20 + 50 proc. WIBID 6M	0,07	-6,03	13,32
Dom Maklerski BOŚ	Portfel IKE/IKZE Równowaga	2,42	0,30	-4,48	-4,21	16,98	-5,08	6,63	40 proc. WIG + 60 proc. WIBID 6M	2,12	-0,27	22,06
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia zrównoważona	4,67	-0,85	-7,48	-5,94	9,87	-11,03	8,16	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	5,52	-1,54	20,90
Dom Maklerski BOŚ	Portfel IKE/IKZE Dynamika	1,50	-0,81	-9,00	-5,31	24,72	-4,55	3,41	60 proc. WIG + 40 proc. WIBID 6M	2,31	-3,69	29,27
Portfele mieszane aktywów zagranicznych – zrównoważone (udział akcji od 40 do 65 proc.)												
mBank Asset Management	Portfel Funduszowy Zrównoważony Odpowiedzialnego Inwestowania*	3,54	-2,04	3,23	7,76	b.d.	b.d.	b.d.	45 proc. MSCI ACWI + 45 proc. BB Glob Aggr + 10 proc. POLONIA - 1,95 proc. p.a.	5,58	-4,53	b.d.
mBank Asset Management	Zrównoważona ESG	3,88	-0,48	-0,81	4,94	28,25	13,99	b.d.	45 proc. MSCI ACWI + 45 proc. BB Global Aggreg.TR H-USD + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	4,36	-5,75	14,26
BM Banku BNP Paribas	Zrównoważony EUR	3,22	-0,55	-5,60	0,37	25,14	10,15	16,00	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&P500 + 2 proc. Topix + 13 proc. MSCI EM]	3,77	-5,97	14,99
BM Banku BNP Paribas	Zrównoważony USD	4,23	-0,61	-5,99	-1,00	25,08	7,82	14,24	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	4,84	-4,99	17,26