

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 2021 r. (kwartałna)	różnica z benchmarkiem (pkt proc.)	styczeń– grudzień 2021 (roczna)	różnica z benchmarkiem (pkt proc.)	trzy- letnia stopa zwrotu	różnica z benchmarkiem (pkt proc.)	pięcio- letnia stopa zwrotu		październik– grudzień 2021 r. (kwartałna)	styczeń– grudzień 2021 (roczna)	trzy- letnia stopa zwrotu
Portfele akcji												
Quercus TFI	Strategia Akcyjna	-4,26	-2,77	38,01	16,49	77,14	57,02	23,91	WIG	-1,49	21,52	20,12
Pekao TFI	Portfel z udziałem akcji od 90 proc. do 100 proc. (MIŚS)	0,94	0,26	37,57	4,50	45,65	10,29	45,48	mWIG40	0,68	33,07	35,36
Esaliens TFI	Portfele Akcyjne – skorelowane	-0,58	0,91	25,80	4,28	54,52	34,40	61,57	WIG	-1,49	21,52	20,12
Pekao TFI	Portfel z udziałem akcji od 90 proc. do 100 proc.	-0,84	0,65	24,48	2,96	22,61	2,49	32,66	WIG	-1,49	21,52	20,12
mBank Asset Management	Małych i Średnich Spółek PL	-2,37	-1,09	23,81	-2,44	b.d.	b.d.	b.d.	60 proc. mWIG40 + 30 proc. sWIG80 + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	-1,28	26,25	b.d.
Dom Maklerski BDM	Akcyjna	-10,08	-8,80	23,21	3,87	1,97	-16,94	b.d.	90 proc. WIG + 10 proc. WIBID 3M	-1,28	19,34	18,91
BM Banku BNP Paribas	Akcji PLN	-8,35	-7,27	21,44	1,64	49,63	44,93	47,41	70 proc. WIG20 + 30 proc. mWIG40	-1,08	19,80	4,70
Dom Maklerski BOŚ	Portfel akcyjny	0,78	2,34	19,68	7,60	16,33	15,87	34,04	WIG20	-1,56	12,08	0,46
Dom Maklerski BOŚ	Portfel małych i średnich spółek	0,27	-0,64	13,79	-18,65	30,25	-5,02	23,10	mWIG40	0,91	32,44	35,27
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia agresywna	-3,55	-2,31	7,11	-12,92	54,39	32,68	65,58	Mediana stopy zwrotu funduszy akcji polskich uniwersalnych zgodnie z klasyfikacją funduszy nadaną przez analizy.pl. Do końca czerwca 2018 r. obowiązywał benchmark: 70 proc. subfundusz Skarbiec Akcja + 30 proc. subfundusz Skarbiec Kasa	-1,24	20,03	21,71
Portfele akcji rynków zagranicznych												
Caspar Asset Management	Strategia Akcji Skoncentrowanych	3,79	-5,80	17,96	-13,63	176,37	81,72	272,82	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI)	9,59	31,59	94,65
Caspar Asset Management	Strategia Akcyjna USA	7,62	-4,21	17,68	-18,92	156,66	40,90	b.d.	100 proc. MSCI Daily Total Return USA USD (NDDUS)	11,83	36,60	115,76
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Akcyjna Selektywna	4,03	-5,56	15,53	-16,06	b.d.	b.d.	b.d.	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI)	9,59	31,59	b.d.
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Akcji Globalnych	2,08	-7,51	13,67	-17,92	b.d.	b.d.	b.d.	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI)	9,59	31,59	nd.
Caspar Asset Management	Strategia Akcji Spółek Strefy Euro	-2,55	-7,43	11,21	-10,54	99,71	37,44	117,16	100 proc. MSCI EMU EUR Net Total Return Index (M7EM)	4,88	21,75	62,27
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Globalna ETF	1,03	-6,36	10,58	-12,82	b.d.	b.d.	b.d.	90 proc. MSCI ACWI Index (USD) (MXWD) + 10 proc. stopa referencyjna NBP	7,39	23,40	b.d.
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia agresywna globalna	-1,55	-6,74	5,25	-8,15	83,50	44,79	b.d.	Mediana stopy zwrotu funduszy akcji globalnych rynków rozwiniętych zgodnie z klasyfikacją funduszy nadaną przez analizy.pl.	5,19	13,40	38,71
mBank Asset Management	Akcyjna Mega Trendy	-0,62	-6,16	2,98	-11,16	b.d.	b.d.	b.d.	90 proc. MSCI_EM + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	5,54	14,14	b.d.
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Absolutnej Stopy Zwrotu Wysokiego Ryzyka	-1,20	-1,46	-2,09	-5,73	-2,26	-22,57	9,50	Stopa zwrotu wyrażona w Euro wynosząca 4 proc. w skali roku	0,26	3,64	20,31
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Spółek Biotechnologicznych i Ochrony Zdrowia	-6,67	-16,40	-7,10	-36,52	b.d.	b.d.	b.d.	100 proc. MSCI Daily Total Return World Net Health Care USD (NDWUHC)	9,73	29,42	b.d.
Portfele mieszane – zrównoważone (udział akcji od 65 proc.)												
Pekao TFI	Portfel z udziałem akcji od 60 proc. do 80 proc.	-1,64	0,66	15,52	2,36	17,17	1,88	27,12	70 proc. WIG + 30 proc. ICE BofA 1-3Y PGI	-2,30	13,16	15,29
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny PLN	-6,89	-4,23	14,84	2,93	41,19	36,21	42,22	52,5 proc. WIG20 + 22,5 proc. mWIG40 + 25 proc. TBSP.Index	-2,66	11,91	4,98
Superfund TFI	Strategia Aktywny Portfel	1,34	3,47	2,54	-10,70	6,84	-8,24	1,79	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	-2,13	13,24	15,08
Superfund TFI	Strategia Aktywna	2,21	3,47	-1,41	-15,93	-7,90	-23,25	-12,27	60 proc. WIG + 20 proc. WIBID 1M + 20 proc. Credit Suisse Managed Futures Liquid Index (USD) minus koszty stałe	-1,26	14,52	15,35
Pekao TFI	Portfel z udziałem akcji od 70 proc. do 90 proc.	-0,93	1,09	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	80 proc. WIG + 20 proc. FTSE PGBL_1_3	-2,02	b.d.	b.d.
Portfele mieszane aktywów zagranicznych – zrównoważone (udział akcji od 65 proc.)												
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny EUR	7,19	2,46	18,05	3,53	49,85	8,98	48,19	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	4,73	14,52	40,87
mBank Asset Management	Dynamicznego Wzrostu ESG	2,74	-1,20	13,22	3,74	b.d.	b.d.	b.d.	65 proc. MSCI ACWI + 25 proc. BB Glob Aggr. TR H-USD + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	3,94	9,48	b.d.
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny USD	5,81	1,96	11,30	1,64	53,08	7,26	63,67	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	3,85	9,66	45,82
Portfele mieszane – zrównoważone (udział akcji od 40 do 65 proc.)												
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Zrównoważony	0,71	1,48	13,97	7,90	24,92	23,51	33,65	50 proc. WIG20 + 50 proc. WIBID 6M	-0,77	6,07	1,41
Dom Maklerski BOŚ	Portfel IKE/IKZE Dynamika	-1,10	-0,22	12,44	0,53	16,02	2,74	30,07	60 proc. WIG + 40 proc. WIBID 6M	-0,88	11,91	13,28
Pekao TFI	Portfel z udziałem akcji od 40 proc. do 60 proc.	-2,47	0,40	9,31	1,53	12,21	0,78	20,86	50 proc. WIG + 50 proc. ICE BofA 1-3Y PGI	-2,87	7,78	11,43
Dom Maklerski BOŚ	Portfel IKE/IKZE Równowaga	-1,73	-1,15	7,60	-0,36	13,89	4,25	26,77	40 proc. WIG + 60 proc. WIBID 6M	-0,58	7,96	9,64
BM Banku BNP Paribas	Zrównoważony PLN	-6,46	-2,20	6,69	2,33	26,62	22,39	30,89	35 proc. WIG20 + 15 proc. mWIG40 + 50 proc. TBSP.Index	-4,26	4,36	4,23
Pekao TFI	Portfel z udziałem akcji od 30 do 50 proc.	-2,73	0,44	5,47	0,32	8,63	-0,70	16,59	40 proc. WIG + 60 proc. ICE BofA 1-3Y PGI	-3,17	5,15	9,33
Skarbiec TFI	Portfel funduszy - strategia zrównoważona	-3,45	-1,06	2,55	-5,67	32,74	19,01	40,13	Mediana stopy zwrotu funduszy mieszanych polskich zrównoważonych zgodnie z klasyfikacją funduszy nadaną przez analizy.pl. Do końca czerwca 2018 r. obowiązywał benchmark: 40 proc. subfundusz Skarbiec Akcja + 60 proc. subfundusz Skarbiec Kasa	-2,39	8,22	13,73
Superfund TFI	Strategia Zrównoważony Portfel	0,80	3,31	1,96	-3,70	7,64	-1,46	5,53	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	-2,51	5,66	9,10
Superfund TFI	Strategia Zrównoważona	1,52	2,28	-1,35	-9,43	-3,24	-12,90	-5,87	30 proc. WIG + 50 proc. WIBID 1M + 20 proc. Credit Suisse Managed Futures Liquid Index (USD) minus koszty stałe	-0,76	8,08	9,66
Portfele mieszane aktywów zagranicznych – zrównoważone (udział akcji od 40 do 65 proc.)												
Caspar Asset Management	Strategia Zrównoważona Akcji Skoncentrowanych	3,00	-2,91	13,65	-4,83	96,45	43,70	b.d.	60 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI) + 40 proc. WIBOR 6M	5,91	18,48	52,75
BM Banku BNP Paribas	Zrównoważony EUR	5,05	2,01	11,76	2,93	32,36	3,19	30,27	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]	3,04	8,83	29,17
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Zrównoważona Globalna ETF + Obligacje	0,69	-4,33	7,97	-7,38	b.d.	b.d.	b.d.	60 proc. MSCI ACWI Index (USD) (MXWD) + 40 proc. stopa referencyjna NBP	5,02	15,35	b.d.
BM Banku BNP Paribas	Zrównoważony USD	3,97	1,28	6,83	0,91	37,82	1,58	44,35	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	2,69	5,92	36,24
mBank Asset Management	Zrównoważona ESG	2,53	-0,18	6,42	0,53	b.d.	b.d.	b.d.	45 proc. MSCI ACWI + 45 proc. BB Global Aggreg.TR H-USD + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	2,71	5,89	b.d.