

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.)		
		kwiecień- czerwiec 2023 r. (kwartałna)	styczeń- czerwiec 2023 r. (półroczna)	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	lipiec 2022- czerwiec 2023 (roczna)	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	trzy- letnia stopa zwrotu	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	pięcio- letnia stopa zwrotu	styczeń- czerwiec 2023 r. (półroczna)		lipiec 2022- czerwiec 2023 (roczna)	trzy- letnia stopa zwrotu	
Portfele akcji polskich														
BM Banku BNP Paribas	Akcji PLN	11,94	22,74	7,22	37,83	17,02	59,66	35,69	48,09	70 proc. WIG20 + 30 proc. mWIG40	15,52	20,81	23,97	
Quercus TFI	Strategia Akcyjna	17,56	23,10	6,01	34,72	9,13	78,20	42,46	62,33	WIG	17,09	25,59	35,74	
mBank Asset Management	Małych i Średnich Spółek PL	7,87	24,35	7,26	34,59	15,53	69,92	29,46	b.d.	60 proc. mWIG40 + 30 proc. sWIG80 + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	17,09	19,06	40,46	
Dom Maklerski BOŚ	Portfel akcyjny	10,81	15,86	0,93	21,07	0,98	28,89	12,19	19,00	WIG20	14,93	20,09	16,70	
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia agresywna	10,11	17,69	0,00	21,03	-3,86	5,36	-27,60	23,49	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.	17,69	24,89	32,96	
Dom Maklerski BOŚ	Portfel małych i średnich spółek	4,85	16,76	-0,73	18,40	1,25	18,07	-19,40	13,93	mWIG40	17,49	17,15	37,47	
Portfele akcji rynków zagranicznych														
mBank Asset Management	Akcyjna Mega Trendy	13,44	10,83	-0,58	27,37	14,48	b.d.	b.d.	b.d.	90 proc. MSCI_EM + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	11,41	12,89	26,00	
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia agresywna globalna	9,10	16,23	0,27	13,23	-5,99	-3,64	-30,57	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	15,96	19,22	26,93	
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Globalna ETF	-0,50	-1,76	-6,81	3,59	-1,44	0,15	-31,60	b.d.	90 proc. MSCI ACWI Index (USD) (MXWD) + 10 proc. stopa referencyjna NBP	5,05	5,03	31,75	
Caspar Asset Management	Strategia Akcji Spółek Strefy Euro	-3,68	0,30	-9,10	2,66	-15,31	-3,47	-42,22	12,35	100 proc. MSCI EMU EUR Net Total Return Index (M7EM)	9,40	17,97	38,75	
Caspar Asset Management	Strategia FOCUS Akcyjna	-0,52	-2,02	-9,39	2,54	-6,03	32,36	-13,26	103,43	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Iindex (NDDUWI)	7,37	8,57	45,62	
Caspar Asset Management	Strategia Akcyjna USA	0,44	-0,86	-9,87	1,75	-7,25	34,70	-16,51	102,53	100 proc. MSCI Daily Total Return USA USD (NDDUUS)	9,01	9,00	51,21	
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Akcji Globalnych	-0,07	-0,38	-7,75	0,65	-7,92	21,33	-24,29	b.d.	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI)	7,37	8,57	45,62	
Caspar Asset Management	Strategia SELECT Akcyjna	-1,18	-3,02	-10,39	-1,21	-9,78	35,20	-10,42	b.d.	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI)	7,37	8,57	45,62	
Caspar Asset Management	Strategia Spółek Biotechnologicznych i Ochrony Zdrowia	9,93	2,79	8,77	-10,98	-8,36	-17,50	-49,39	b.d.	100 proc. MSCI Daily Total Return World Net Health Care USD (NDWUHC)	-5,98	-2,62	31,89	
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Absolutnej Stopy Zwrotu Wysokiego Ryzyka	-6,19	-11,75	-8,50	-16,09	-14,96	-11,83	-23,88	-17,49	Stopa zwrotu wyrażona w Euro wynosząca 4 proc. w skali roku	-3,25	-1,13	12,05	
Michael/Ström Dom Maklerski	Strategia Agresywna	3,12	7,73	-5,28	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	100 proc. średnia funduszy akcji globalnych rynków rozwiniętych	13,01	b.d.	b.d.	
Portfele mieszane - zrównoważone (udział akcji od 65 proc.)														
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny PLN	9,64	19,12	5,68	30,61	11,94	42,95	26,70	42,60	52.5 proc. WIG20 + 22.5 proc. mWIG40 + 25 proc. TBSP.Index	13,44	18,67	16,25	
Superfund TFI	Strategia Aktywny Portfel	9,67	10,81	1,03	17,76	2,50	32,29	29,20	23,67	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	9,78	15,26	3,09	
Superfund TFI	Strategia Aktywna	9,56	10,39	29,03	17,12	44,59	34,38	68,25	24,57	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	-18,64	-27,47	-33,87	
Portfele mieszane aktywów zagranicznych – zrównoważone (udział akcji od 65 proc.)														
mBank Asset Management	Dynamicznego Wzrostu ESG	2,97	9,19	0,26	10,34	1,38	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.	8,93	8,96	b.d.	
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny USD	2,68	7,84	-1,04	9,88	-0,49	26,22	8,34	36,98	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	8,88	10,37	17,88	
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny EUR	1,49	5,14	-1,76	5,28	-1,21	26,68	8,55	32,67	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	6,90	6,49	18,13	
Portfele mieszane – zrównoważone (udział akcji od 40 do 65 proc.)														
BM Banku BNP Paribas	Zrównoważony PLN	7,33	15,48	4,12	23,39	6,86	26,63	18,11	32,22	35 proc. WIG20 + 15 proc. mWIG40 + 50 proc. TBSP.Index	11,36	16,53	8,52	
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Zrównoważony	7,40	11,79	3,46	18,14	5,38	28,60	16,55	28,68	50 proc. WIG20 + 50 proc. WIBID 6M	8,33	12,76	12,05	
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia zrównoważona	7,15	12,78	0,11	16,23	-2,75	1,98	-13,89	14,76	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	12,67	18,98	15,87	
Superfund TFI	Strategia Zrównoważony Portfel	5,83	7,16	-1,50	12,70	-1,28	19,81	14,32	19,68	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	8,66	13,98	5,49	
Dom Maklerski BOŚ	Portfel IKE/IKZE Dynamika	8,53	10,16	0,19	12,04	-5,55	21,50	-2,82	15,01	60 proc. WIG + 40 proc. WIBID 6M	9,97	17,59	24,32	
Superfund TFI	Strategia Zrównoważona	5,62	6,32	18,13	11,41	23,22	23,53	47,01	21,36	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	-11,81	-11,81	-23,48	
Dom Maklerski BOŚ	Portfel IKE/IKZE Równowaga	6,04	8,60	0,81	10,60	-3,49	14,64	-4,63	14,22	40 proc. WIG + 60 proc. WIBID 6M	7,79	14,09	19,27	
Portfele mieszane aktywów zagranicznych – zrównoważone (udział akcji od 40 do 65 proc.)														
mBank Asset Management	Zrównoważona ESG	3,63	7,64	0,67	12,00	5,37	20,46	12,71	b.d.	45 proc. MSCI ACWI + 45 proc. BB Global Aggr. TR H-USD + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	6,97	6,63	7,75	
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia zrównoważona globalna	6,44	12,42	0,43	11,44	-4,42	-3,34	-20,44	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	11,99	15,86	17,10	
mBank Asset Management	Portfel Funduszy Zrównoważony Odpowiedzialnego Inwestowania*	2,04	5,66	-0,21	8,23	4,12	b.d.	b.d.	b.d.	45 proc. MSCI ACWI + 45 proc. BB Glob Aggr + 10 proc. POLONIA - 1,95 proc. p.a.	5,87	4,11	b.d.	
BM Banku BNP Paribas	Zrównoważony USD	1,34	5,63	-1,07	6,28	-0,62	11,86	3,84	21,44	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	6,70	6,90	8,02	