

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 2022 r. (kwartałna)	styczeń- wrzesień 2022 r. (od początku roku)	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	październik 2021- wrzesień 2022 (roczna)	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	trzy- letnia stopa zwrotu	różnica z bench- markiem (pkt proc.)	pięcio- letnia stopa zwrotu	styczeń- wrzesień 2022 r. (od początku roku)		październik 2021- wrzesień 2022 (roczna)	trzy- letnia stopa zwrotu	
Portfele akcji														
mBank Asset Management	Małych i Średnich Spółek PL	-2,91	-14,90	11,72	-16,92	10,64	25,68	18,89	b.d.	60 proc. mWIG40 + 30 proc. sWIG80 + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	-26,62	-27,56	6,79	
Dom Maklerski BOŚ	Portfel małych i średnich spółek	-9,62	-26,45	7,44	-26,25	7,04	-12,07	-6,00	-20,60	mWIG40	-33,89	-33,29	-6,07	
Quercus TFI	Strategia Akcyjna	-6,00	-24,79	8,87	-28,29	6,36	28,60	48,40	-10,62	WIG	-33,66	-34,65	-19,80	
Dom Maklerski BOŚ	Portfel akcyjny	-13,01	-29,10	9,48	-28,55	10,99	-19,19	17,28	-21,15	WIG20	-38,58	-39,54	-36,47	
BM Banku BNP Paribas	Akcji PLN	-12,22	-27,93	9,31	-32,51	5,40	8,59	39,75	-8,05	70 proc. WIG20 + 30 proc. mWIG40	-37,24	-37,91	-31,16	
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia agresywna	-3,88	-30,08	1,33	-32,56	-0,30	0,91	16,97	-3,43	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	-31,41	-32,26	-16,06	
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Akcji Polskich	-10,21	-26,40	13,53	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	MSCI Poland Total Return Index	-39,93	nd.	nd.	
Portfele akcji rynków zagranicznych														
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Absolutnej Stopy Zwrotu Wysokiego Ryzyka	8,19	14,52	5,50	13,14	3,83	-1,06	-26,28	18,18	Stopa zwrotu wyrażona w Euro wynosząca 4 proc. w skali roku	9,02	9,31	25,22	
Caspar Asset Management	Strategia Akcyjna USA	7,93	-8,26	0,33	-1,27	-3,50	73,78	19,43	178,48	100 proc. MSCI Daily Total Return USA USD (NDDUS)	-8,59	2,23	54,35	
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Akcyjna Selektywna	7,34	-5,16	3,86	-1,33	-1,04	b.d.	b.d.	b.d.	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI)	-9,02	-0,29	b.d.	
Caspar Asset Management	Strategia Akcji Skoncentrowanych	12,23	-8,67	0,35	-5,20	-4,91	88,58	47,03	157,97	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI)	-9,02	-0,29	41,55	
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Globalna ETF	9,68	-15,53	-6,36	-14,66	-12,20	18,88	-10,29	b.d.	90 proc. MSCI ACWI Index (USD) (MXWD) + 10 proc. stopa referencyjna NBP	-9,17	-2,46	29,17	
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Akcji Globalnych	7,97	-17,26	-8,24	-15,54	-15,25	b.d.	b.d.	b.d.	100 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI)	-9,02	-0,29	b.d.	
mBank Asset Management	Akcyjna Mega Trendy	-5,68	-30,57	-6,09	-31,00	-10,70	44,21	39,64	b.d.	90 proc. MSCI_EM + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	-24,48	-20,30	4,57	
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia agresywna globalna	-2,24	-33,02	-10,66	-34,06	-15,73	7,03	11,20	b.d.	Mediana stopy zwrotu funduszy akcji globalnych rynków rozwiniętych zgodnie z klasyfikacją funduszy nadaną przez analizy.pl.	-22,36	-18,33	-4,17	
Caspar Asset Management	Strategia Akcji Spółek Strefy Euro	-2,80	-33,83	-16,05	-35,51	-21,74	3,65	-6,18	b.d.	100 proc. MSCI EMU EUR Net Total Return Index (M7EM)	-17,78	-13,77	9,83	
Caspar Asset Management	Specjalistyczna Strategia Spółek Biotechnologicznych i Ochrony Zdrowia	9,89	-33,88	-35,88	-38,29	-50,21	41,40	-18,68	b.d.	100 proc. MSCI Daily Total Return World Net Health Care USD (NDWUHC)	2,00	11,92	60,08	
Portfele mieszane – zrównoważone (udział akcji od 65 proc.)														
Superfund TFI	Strategia Aktywna	-13,54	-16,89	-0,34	-15,05	2,55	-28,31	-24,63	-30,81	60 proc. WIG + 20 proc. WIBID 1M + 20 proc. Credit Suisse Managed Futures Liquid Index (USD) minus koszty stałe	-16,55	-17,60	-3,68	
Superfund TFI	Strategia Aktywny Portfel	-4,97	-19,31	-1,65	-18,23	1,19	-14,78	-9,30	-23,21	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	-17,66	-19,42	-5,48	
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny PLN	-8,72	-22,33	8,22	-27,68	4,71	8,53	33,87	-2,51	52.5 proc. WIG20 + 22.5 proc. mWIG40 + 25 proc. TBSP.Index	-30,55	-32,39	-25,34	
Portfele mieszane aktywów zagranicznych – zrównoważone (udział akcji od 65 proc.)														
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny EUR	-2,30	-10,57	4,31	-4,14	6,71	15,65	10,38	21,25	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	-14,88	-10,85	5,27	
BM Banku BNP Paribas	Dynamiczny USD	-7,31	-20,03	3,00	-15,39	4,67	9,70	8,33	10,42	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	-23,03	-20,06	1,37	
mBank Asset Management	Dynamicznego Wzrostu ESG	-3,14	-17,67	3,22	-15,42	2,35	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.	-20,89	-17,77	b.d.	
Portfele mieszane – zrównoważone (udział akcji od 40 do 65 proc.)														
Superfund TFI	Strategia Zrównoważona	-10,35	-13,20	-8,46	-11,88	-6,41	-21,12	-25,14	-21,55	30 proc. WIG + 50 proc. WIBID 1M + 20 proc. Credit Suisse Managed Futures Liquid Index (USD) minus koszty stałe	-4,74	-5,47	4,02	
Superfund TFI	Strategia Zrównoważony Portfel	-3,13	-14,15	-6,93	-13,47	-3,92	-8,78	-8,97	-14,75	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	-7,22	-9,55	0,19	
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Zrównoważony	-7,28	-19,80	-2,35	-19,24	-1,32	-2,82	12,98	-6,28	50 proc. WIG20 + 50 proc. WIBID 6M	-17,45	-17,92	-15,80	
Dom Maklerski BOŚ	Portfel IKE/IKZE Równowaga	-7,95	-18,38	-7,33	-19,80	-8,37	-8,68	-3,66	-8,52	40 proc. WIG + 60 proc. WIBID 6M	-11,05	-11,43	-5,02	
BM Banku BNP Paribas	Zrównoważony PLN	-6,72	-17,58	5,90	-22,90	3,84	2,67	22,73	-1,64	35 proc. WIG20 + 15 proc. mWIG40 + 50 proc. TBSP.Index	-23,48	-26,74	-20,06	
Dom Maklerski BOŚ	Portfel IKE/IKZE Dynamika	-12,44	-24,85	-6,43	-25,68	-6,67	-12,97	-2,99	-16,66	60 proc. WIG + 40 proc. WIBID 6M	-18,42	-19,01	-9,98	
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – strategia zrównoważona	-2,30	-23,10	-0,29	-25,76	-1,04	-3,43	9,85	-3,32	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	-22,81	-24,72	-13,28	
Portfele mieszane aktywów zagranicznych – zrównoważone (udział akcji od 40 do 65 proc.)														
Caspar Asset Management	Strategia Zrównoważona Akcji Skoncentrowanych	7,17	-5,68	-2,01	-2,85	-4,87	53,22	25,62	b.d.	60 proc. MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI) + 40 proc. WIBOR 6M	-3,67	2,02	27,60	
BM Banku BNP Paribas	Zrównoważony EUR	-2,45	-11,17	3,48	-6,68	5,38	5,29	6,51	9,47	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&P 500 + 2 proc. Topix + 13 proc. MSCI EM]	-14,65	-12,06	-1,22	
mBank Asset Management	Zrównoważona ESG	-1,01	-12,81	5,15	-10,60	5,13	10,68	13,01	b.d.	45 proc. MSCI ACWI + 45 proc. BB Global Aggr. TR H-USD + 10 proc. POLONIA - 1 proc. p.a.	-17,96	-15,73	-2,33	
mBank Asset Management	Portfel Funduszy Zrównoważony Odpowiedzialnego Inwestowania	-1,58*	-14,16*	-12,72	-12,37*	-0,59	b.d.	b.d.	b.d.	45 proc. MSCI ACWI + 45 proc. BB Glob Aggr + 10 proc. POLONIA - 1.95 proc. p.a.	-1,44	-11,78	b.d.	
BM Banku BNP Paribas	Zrównoważony USD	-6,24	-18,37	1,72	-15,13	2,81	2,04	3,38	3,32	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	-20,09	-17,94	-1,34	