

## W ramach platformy AEGON

Niniejszy wykaz powstał w oparciu o dane historyczne i w żadnym wypadku nie stanowi zapowiedzi powtórzenia się w przyszłości wyników funduszy. Jest to uszeregowanie funduszy w zgodzie na poniższą metodyką:

- stopa zwrotu w okresie 3 m-cy, roku i 3 lat,
- współczynnik zmienności: stosunek zmienności stopy zwrotu do średniej stopy zwrotu dla danego okresu. Określa ile ryzyka przypadło na jednostkę zysku,
- wskaźnik Sharpa: określa relację premii za ryzyko. Liczony jest jako stosunek stopy zwrotu z funduszu ponad stopę zwrotu wolną od ryzyka, do miary zmienności funduszu. Im wyższa wartość wskaźnika, tym korzystniejszy stosunek ryzyka do zysku,
- wskaźnik Information Ratio: analogiczny do wskaźnika Sharpa, jednak odnosi się on do benchmarku, a nie do stopy wolnej od ryzyka.

Zestawienia nie należy odbierać jako rekomendacji w zakresie doboru funduszy inwestycyjnych do portfela. Dobór funduszy do portfela jest osobistą decyzją inwestora, podejmowaną wyłącznie na jego własne ryzyko.

Przedstawiony wykaz funduszy został przygotowany na podstawie informacji dostępnych publicznie i uznanych przez Phinance S.A. za wiarygodne. Wykaz nie stanowi rekomendacji w zakresie doboru funduszy inwestycyjnych do portfela. Wybór funduszy do portfela jest osobistą decyzją inwestora, podejmowaną w oparciu o własne potrzeby oraz posiadaną wiedzę i doświadczenie inwestycyjne, oraz możliwości i chęci podejmowania ryzyka inwestycyjnego.

## 01.

### FUNDUSZE AKCJI POLSKICH UNIWERSALNE

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
	3 M	12 M	36 M		
INVESTOR AKCJI	-1,08	5,04	28,93	0,33	0,37
QUERCUS AGRESYWNY	-2,35	-0,11	8,65	0,29	0,23
PKO AKCJI PLUS	-2,27	-3,60	8,61	0,12	0,11
SUBFUNDUSZ AVIVA INVESTORS POLSKICH AKCJI	-1,65	-6,59	3,56	0,16	0,03
ALLIANZ SELEKTYWNY	-4,29	-5,68	0,34	0,06	0,03
UNIFUNDUSZE SUBFUNDUSZ UNIKORONA AKCJI	-4,74	-11,09	-5,23	-0,47	-0,07
SUBFUNDUSZ NOBLE FUND AKCJI	-3,22	-2,57	-6,26	-0,81	-0,19
LEGG MASON SUBFUNDUSZ AKCJI	-6,80	-14,11	-7,74	-0,69	-0,19
SUBFUNDUSZ AKCJI SKARBIEC AKCJA	-5,04	-8,04	-12,59	-0,61	-0,3
ARKA PRESTIŻ POLSKICH AKCJI	-4,59	-4,32	13,68	0,04	B.D.

## 02.

### FUNDUSZE POLSKICH AKCJI MAŁYCH I ŚREDNICH SPÓŁEK

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
	3 M	12 M	36 M		
SKARBIEC MAŁYCH I ŚREDNICH SPÓŁEK	0,45	4,06	32,08	0,89	0,09
SUBFUNDUSZ NOBLE FUND AKCJI MIŚŚ	2,01	11,61	32,25	0,2	0,08
INVESTOR TOP 25 MAŁYCH SPÓŁEK	-3,41	2,15	26,95	0,03	-0,11
AVIVA INVESTORS NOWYCH SPÓŁEK	1,25	-0,45	16,36	-0,16	0,21
PZU AKCJI MAŁYCH I ŚREDNICH SPÓŁEK	-1,34	6,94	14,14	-1,82	-0,26

## 03.

### FUNDUSZE AKCYJNE ZAGRANICZNE

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
	3 M	12 M	36 M		
FRANKLIN U.S. OPPORTUNITIES	7,61	15,06	79,72	0,34	0,07
JP MORGAN EUROPE EQUITY PLUS	8,01	16,63	73,74	0,41	0,27
BLACKROCK EUROPEAN VALUE	5,04	12,31	42,11	0,33	0,21
FRANKLIN EUROPEAN SMALL MID CAP GROWTH	3,48	22,36	55,54	0,36	0
NN GLOBALNY SPÓŁEK DYWIDENDOWYCH	6,85	5,29	39,14	0,28	0,44
SCHRODER GLOBAL SMALLER COMPANIES	-0,97	7,84	46,1	0,1	0,39
JP MORGAN JAPAN STRATEGIC VALUE	7,71	18,63	54,18	0,24	0,03
SCHRODER US SMALL MID CAP EQUITY	-5,34	-2,87	35,46	0,36	0,18
ALLIANZ EUROPE EQUITY GROWTH	7,61	18,48	44,34	0,29	0,07
FIDELITY GREATER CHINA	9,36	5,56	36,23	0,21	0,15
JP MORGAN HIGHBRIDGE US STEEP FUND	-1,19	-9,09	68,84	0,57	-0,02
FRANKLIN EUROPEAN GROWTH	3,55	6,34	25,56	0,21	-0,02
FRANKLIN INDIA	1,3	2,6	47,63	0,2	0,01
BLECKROCK GLOBAL SMALL CAP	-0,12	-5,58	9,04	0,09	-0,01
FIDELITY EMERGING MARKETS	7,51	2,7	19,56	0,31	0,06
SCHRODER GLOBAL DEMOGRAPHICS OPPORTUNITIES	2,9	2,6	29,7	0,14	0,04
FRANKLIN GLOBAL SMALL MID CAP	-3,61	4,11	18,22	0,38	0,01
JP MORGAN GREATER CHINA	3,12	-0,01	17,74	0,13	0,04
JP MORGAN ASEAN EQUITY	9,6	-6,84	9,76	-0,27	-0,24
ALLIANZ GLOBAL EQUITY	5,64	-0,42	17,7	0,23	0,24
AEGON CENTRAL EUROPEAN EQUITY	-5,21	-1,92	-11,16	-0,04	B.D.
TEMPLETON ASIAN GROWTH	1,18	-26,93	-26,25	-1,18	-0,11

## W ramach platformy AEGON

## 03. FUNDUSZE AKCYJNE ZAGRANICZNE

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
	3 M	12 M	36 M		
AEGON AKCJI ROSYJSKICH	-1,7	14,47	32,20	-0,08	B.D.
AEGON AKCJI TURECKICH	1,01	-24,96	-30,69	-0,09	B.D.
BLACKROCK EMERGING MARKETS	-0,9	-2,18	-16,35	-0,03	-0,15
FIDELITY LATIN AMERICA	1,12	-20,34	36,6	-0,2	0,2
TEMPLETON LATIN AMERICA	-0,57	-26,88	-50,8	-0,34	-0,03
FIDELITY ASEAN	6,99	-16,96	-17,22	-0,11	B.D.
FIDELITY AMERICA	7,83	2,09	B.D.	B.D.	B.D.

## 04. FUNDUSZE OBLIGACJI POLSKICH

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
	3 M	12 M	36 M		
UNIWIBID PLUS	0,55	2,44	11,17	0,73	-0,04
UNIOBLIGACJE AKTYWNY	0,15	-0,92	14,01	0,24	0,16
AVIVA INVESTORS DŁUŻNYCH PAPIERÓW KORPOR.	0,48	2,3	10,84	0,24	0,06
ARKA OBLIGACJI SKARBOWYCH	0,19	-0,48	8,68	0,1	-0,06
AVIVA INVESTORS OBLIGACJI	0,12	-0,25	7,07	-0,03	-0,26
PKO PAPIERÓW DŁUŻNYCH PLUS	0,72	0,57	6,61	-0,04	B.D.
ARKA PRESTIŻ OBLIGACJI KORPORACYJNYCH	0,77	1,85	10,74	0,23	B.D.
AEGON POLISCH BOND	-0,69	-0,45	B.D.	B.D.	B.D.

## 05. FUNDUSZE OBLIGACJI ZAGRANICZNYCH

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
	3 M	12 M	36 M		
JP MORGAN US BOND	-0,93	-1,58	6,39	0,14	0,15
JP MORGAN GLOBAL HIGH YELD BOND USD	-1,67	-5,1	4,84	0,07	0,67
UNI EURIBOR EUR	0,13	0,57	3,3	0,75	B.D.
FRANKLIN STRATEGIC INCOME	-1,49	-4,86	-2,25	-0,05	0,76
TEMPLETON GLOBAL TOTAL RETURN USD	2,68	-5,77	-2,68	0,14	-0,05
TEMPLETON GLOBAL TOTAL RETURN EUR	4,44	3,87	14,61	0,14	-0,05
HSBC GLOBAL EMERGING MARKETS BOND USD	1,33	-1,93	-5,53	-0,07	0,03
FIDELITY EUROPEAN HIGH YELD	0,92	0,66	11,33	0,22	B.D.
BLACKROCK FIXED INCOME GLOBAL OPPORTUNITIES	-0,32	-2	B.D.	B.D.	-0,01
CREDIT SUISSE BOND HIGH YELD	-2,48	-3,95	B.D.	B.D.	B.D.

## 06. FUNDUSZE RYNKU PIENIĘŻNEGO

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
	3 M	12 M	36 M		
UNIKORONA PIENIĘŻNY	0,39	1,56	10,49	0,23	0,36
PKO SKARBOWY	0,62	1,24	6,83	0,17	-0,67
ALLIANZ SKARBOWY	0,21	-0,77	7,3	0	0
AEGON BEZPIECZNY PIENIĘŻNY	0,27	0,91	B.D.	B.D.	B.D.

Źródła: Analizy On-Line, TFI i opracowania własne

## Zastrzeżenia prawne:

Niniejszy dokument został przygotowany przez Phinance S.A. (Phinance) zgodnie ze stanem nadzień 24.11.2015r. i jest przeznaczony wyłącznie dla pracowników, współpracowników oraz Klientów i potencjalnych Klientów Phinance. Publikowanie w jakiegokolwiek formie oraz udostępnianie niniejszego opracowania w części lub całości innym osobom lub podmiotom wymaga zgody ze strony Phinance. Materiał został przygotowany na podstawie informacji publicznie dostępnych i źródeł uznanych przez Phinance za wiarygodne, ale Phinance nie gwarantuje i nie może zapewnić o ich dokładności, kompletności i wiarygodności. Niniejszy dokument ma charakter wyłącznie informacyjny i nie stanowi wystarczającej podstawy do podjęcia jakiegokolwiek decyzji inwestycyjnej. Wyniki inwestycyjne uzależnione są od sytuacji na rynkach finansowych, skłonności do podejmowania ryzyka oraz kosztów inwestycji. Klient musi liczyć się z możliwością utraty przynajmniej części wpłaconych środków, zwłaszcza w przypadku inwestowania środków w instrumenty o wysokim poziomie ryzyka. Niniejsze opracowanie nie ma charakteru rekomendacji dotyczącej instrumentów finansowych w rozumieniu zapisów Rozporządzenia Ministra Finansów z 19 października 2005 roku w sprawie informacji stanowiących rekomendacje dotyczące instrumentów finansowych, ich emitentów lub wystawców. Oceny Phinance mogą się zmieniać w czasie w zależności od sytuacji rynkowej i ekonomicznej bez obowiązku każdorazowego informowania o tym fakcie. Phinance, jej pracownicy, członkowie władz ani podmioty dominujące i stowarzyszone z Phinance nie ponoszą jakiegokolwiek odpowiedzialności za działania lub zaniechania podjęte na podstawie niniejszego dokumentu, w szczególności za podjęte decyzje inwestycyjne ani za szkody poniesione w wyniku tych decyzji inwestycyjnych.