

W ramach platformy AXA

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 metodykę:

- 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		
SUBFUNDUSZ QUERCUS SELEKTYWNY	0,31	4,58	18,52	0,23	-0,01
SUBFUNDUSZ 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
IPOPEMA AKCJI	-3,1	-5,89	-2,54	-0,06	-0,07
AXA AKCJI	-4,49	-13,03	-5,8	-0,09	-0,13
AXA AKCJI DUŻYCH SPÓŁEK	-5,66	-10,24	-7,58	-0,09	-0,16
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
CASPAR AKCJI POLSKICH	-2,79	-6,15	15,99	0,08	0,21
UNIAKCJE WZROSTU	-1,17	-5,62	8,23	0,03	B.D.
SUBFUNDUSZ QUERCUS LEV	-20,36	-38,19	-53,8	-0,21	-0,13

02.

FUNDUSZE AKCJI MAŁYCH I ŚREDNICH SPÓŁEK

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
	3 M	12 M	36 M		
SUBFUNDUSZ NOBLE FUND AKCJI MIŚS	2,01	11,61	32,25	0,2	0,08
UNIAKCJE MAŁYCH I ŚREDNICH SPÓŁEK	-2,4	2,6	24,28	0,21	-0,08
AXA AKCJI MAŁYCH I ŚREDNICH SPÓŁEK	1,21	0,49	B.D.	B.D.	B.D.
INVESTOR TOP 25 MAŁYCH SPÓŁEK	-3,41	2,15	26,95	0,03	-0,11

03.

FUNDUSZE AKCJI ZAGRANICZNYCH

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
	3 M	12 M	36 M		
AXA EUROPE SMALL CAP	10,93	31,98	85,79	0,47	0,24
AXA EURO RELATIVE VALUE	7,85	12,05	40,95	0,23	B.D.
SKARBIEC SPÓŁEK WZROSTOWYCH	4,17	1,39	27,63	0,15	0,37
AXA SELECTIVE EQUITY	2,82	-13,43	12,78	0,06	0,07
TEMPLETON FRONTIER MARKETS	-3,76	-14,44	0,48	-0,04	0,13
ALLIANCEBERNSTEIN JAPAN	14,07	17,81	B.D.	B.D.	B.D.
SCHRODER GREATER CHINA	11,61	7,73	B.D.	B.D.	B.D.
AXA GLOBAL	9,33	7,58	B.D.	B.D.	B.D.
FIDELITY EM.EUROPE MID.EAST AND AFRICA	-0,76	0,23	B.D.	B.D.	B.D.
AXA EUROPE EMERGING	1,06	1,44	-17,15	-0,14	-0,01
BLACKROCK GLOBAL EQUITY INCOME	6,25	2,33	B.D.	B.D.	B.D.
FIDELITY GLOBAL REAL ASSET SOLUTIONS	2,62	-10,27	B.D.	B.D.	B.D.
AXA AKCJI SPÓŁEK DYWIDENDOWYCH	-0,19	-9,07	B.D.	B.D.	B.D.
INVESTOR TURCJA	3,71	-20,16	B.D.	B.D.	B.D.
TEMPLETON FRONTIER MARKETS	-3,5	-14,51	B.D.	B.D.	B.D.
TEMPLETON BRIC	2,77	-15,75	-28,21	-0,07	0,02
TEMPLETON LATIN AMERICA	-0,57	-28,96	-50,24	-0,34	-0,03

W ramach platformy AXA

04. FUNDUSZE OBLIGACJI ZAGRANICZNYCH

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
	3 M	12 M	36 M		
AXA US CORPORATE BOND	2,86	11,69	B.D.	B.D.	B.D.
ALLIANCEBERSTEIN GLOBAL HIGH YIELD	1,48	5,46	B.D.	B.D.	B.D.
TEMPLETON GLOBAL BOND	2,75	-4,48	1,44	-0,17	0,05

05. FUNDUSZE OBLIGACJI POLSKICH

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
	3 M	12 M	36 M		
PKO OBLIGACJI DŁUGOTERMINOWYCH	0,93	1,08	9,84	0,07	-0,05
AXA OBLIGACJI	0,37	0,12	9,43	0,05	0,11
OPEN FINANCE OBLIGACJI	-0,95	-2,10	6,53	0,16	-0,2
AXA OBLIGACJI KORPORACYJNYCH	0,09	0,62	9,36	0,18	-0,04
ARKA PRESTIŻ OBLIGACJI KORPORACYJNYCH	0,77	1,85	10,74	0,23	B.D.
NOBLE FUND OBLIGACJI	0,63	0,74	B.D.	B.D.	B.D.

06. FUNDUSZE RYNKU PIENIĘŻNEGO

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
	3 M	12 M	36 M		
AXA LOKACYJNY	0,5	1,49	6,69	-0,13	-0,64
PKO SKARBOWY	0,62	1,24	6,83	0,17	-0,67

źródło: Anality 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.