

W ramach platformy COMPENSA

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

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
	3 M	12 M	36 M		
INVESTOR TOP 50 MAŁYCH I ŚREDNICH SPÓŁEK	-0,55	-3,45	4,76	0,08	0,14
UNIFUNDUSZE SUBFUNDUSZ UNIKORONA AKCJI	-4,74	-11,09	-5,23	-0,47	-0,07
LEGG MASON SUBFUNDUSZ AKCJI	-6,80	-14,11	-7,74	-0,69	-0,19
SUBFUNDUSZ ARKA AKCJI	-4,7	-9,26	-10,85	-0,14	-0,36
SKARBIEC AKCJA	-5,04	-8,04	-12,59	-0,61	-0,3

02. FUNDUSZE AKCJI ZAGRANICZNYCH

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
	3 M	12 M	36 M		
ARTS BEST MOMENTUM	2,67	-3,47	29,13	0,2	B.D.
ARTS TOTAL RETURN DYNAMIC	-0,53	-3,68	19,34	0,13	B.D.
HSBC GIF BRIC EQUITY	1,21	-16,33	-27,3	-0,06	0,02
C-QUADRAT ARTS TOTAL RETURN FLEXIBLE	0,64	1,14	22,81	0,17	B.D.
NN GLOBALNY SPÓŁEK DYWIDENDOWYCH	6,85	5,29	39,14	0,28	0,44
BPH GLOBALNY ŻYWNOCI I SUROWCÓW	-7,03	-21,68	-38,61	-0,46	0,15

03. FUNDUSZE OBLIGACJI

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
	3 M	12 M	36 M		
ARKA OBLIGACJI SKARBOWYCH	0,19	-0,48	8,68	0,1	-0,06
NN OBLIGACJI	0,39	-0,21	11,23	0,02	-0,01
C-QUADRAT ARTS TOTAL RETURN BOND	-2,35	-1,03	B.D.	B.D.	B.D.

04. FUNDUSZE MIESZANE

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
	3 M	12 M	36 M		
ARKA ZRÓWNOWAŻONY	-2,18	-5,86	-1,07	-0,1	-0,09
LEGG MASON STRATEG	-2,98	-11,68	-8,08	-0,14	-0,05
ARTS TOTAL RETURN BALANCED	-2,24	-3,1	16,8	0,13	0,6
ARKA STABILNEGO WZROSTU	-0,97	-3,97	1,55	-0,1	-0,18

05. FUNDUSZE BEZPIECZNE

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
	3 M	12 M	36 M		
GWARANTOWANY COMPENSA	0,23	1,15	6,42	-0,79	1,16

Źródło: 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 całości lub części 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.