

W ramach platformy METLIFE

Niniejszy wykaz powstał w oparciu o dane historyczne i w żadnym wypadku nie stanowi on zapowiedzi powtórzenia się w przyszłości wyników funduszy.

Jest to uszeregowanie funduszy w zgodzie z 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, doświadczenie inwestycyjne oraz możliwości i chęć podejmowania ryzyka inwestycyjnego.

01. FUNDUSZE POLSKICH AKCJI

FUNDUSZE	SYMBOLE UFK	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
		3 M	12 M	36 M		
ALTUS AKCJI	102	-2,46	-5,24	8,7	0,04	0,07
INVESTOR TOP 25 MAŁYCH SPÓŁEK	107	5,31	-3,57	12,99	0,07	0
IPOPEMA AKCJI	077	-1,58	-9,74	-6,83	-0,1	-0,3
IPOPEMA M-INDEKS	124	2	-5,2	BD	BD	BD
METLIFE AKCJI	088	-3,66	-15,49	-12,13	-0,11	-0,06
METLIFE AKCJI ŚREDNICH SPÓŁEK	064	1,48	-6,17	14,83	0,07	-0,02
NOBLE FUND AKCJI	098	-3,52	-11,98	-8,79	-0,11	-0,19
NOBLE FUND AKCJI MAŁYCH I ŚREDNICH SPÓŁEK	097	0,7	-2,98	10,54	0,05	-0,02
QUERCUS AGRESYWNY	105	-2,45	-5,88	1,4	-0,02	0,01
SKARBIEC AKCJA	081	0,81	-13,66	-11,89	-0,12	-0,07
SKARBIEC MAŁYCH I ŚREDNICH SPÓŁEK	082	2,54	-3,22	12,95	0,07	0
UNIAKCJE WZROSTU	091	-2,5	-3,84	6,73	0,03	0,06

02. FUNDUSZE POLSKIE MIESZANE

FUNDUSZE	SYMBOLE UFK	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
		3 M	12 M	36 M		
ALTUS ABSOLUTNEJ STOPY ZWROTU DŁUŻNY	101	0,01	2,92	13,46	0,32	BD
ALTUS ABSOLUTNEJ STOPY ZWROTU R.POLSKIEGO	100	-0,73	5,75	10,87	0,18	0,08
INVESTOR ZABEZPIECZENIA EMERYTALNEGO	108	4,41	1,5	19,84	0,23	0,19
IPOPEMA MARKO ALOKACJI	076	1,24	-1,18	2,78	-0,08	-0,08
METLIFE STABILNEGO WZROSTU	063	-0,89	-4,66	0,58	-0,11	-0,06
NOBLE FUND MIESZANY	099	-1,71	-5,91	0,12	-0,05	0,07
NOBLE FUND STABILNEGO WZROSTU PLUS	096	-1,46	-2,06	15,58	0,15	0,17
QUERCUS OCHRONY KAPITAŁU	104	0,63	2,3	8,58	0,8	0,02
QUERCUS SELEKTYWNY	103	-2,06	-1,24	8,55	0,05	0,02

03. FUNDUSZE OBLIGACJI POLSKICH

FUNDUSZE	KODY UFK	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR	INSTRUMENTY BEZPIECZNE*	DURATION***
		3 M	12 M	36 M				
IPOPEMA OBLIGACJI	115	0,78	4,27	11,84	0,24	0,09	38	2,04
METLIFE OBLIGACJI PLUS	062	0,88	2,16	12,11	0,2	0,05	45	2,88
SKARBIEC LOKACYJNY	084	1,98	2,43	11,02	0,13	0,05	4	BD
UNIKORONA OBLIGACJE	076	0,25	1,52	8,66	0,1	-0,23	86	3,22
UNIOBLIGACJE AKTYWNY	090	0,89	3,34	18,38	0,24	0,13	58	5,17

04. FUNDUSZE RYNKU PIENIĘŻNEGO

FUNDUSZE	KODY UFK	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR	INSTRUMENTY BEZPIECZNE*
		3 M	12 M	36 M			
METLIFE PIENIĘŻNY	061	0,49	1,5	7,89	0,35	0,2	43
SKARBIEC KASA	083	0,36	1,34	5,44	-0,31	-0,2	60
UNIKORONA PIENIĘŻNY	089	0,69	1,88	9,4	0,34	0,38	46

**PW (Pozycja Walutowa) określa czy w przypadku ekspozycji funduszu inwestycyjnego na zagraniczne instrumenty finansowe, inwestycja realizowana przez fundusz inwestycyjny narażona jest, obok ryzyka inwestycyjnego, na ryzyko zmian kursu walutowego. W przypadku braku Pozycji Walutowej (PW = NIE) niewielkie zyski lub straty wynikające z ryzyka walutowego nie mogą zostać wykluczone.

***DURATION (czas trwania obligacji) określa stopień wrażliwości części obligacyjnej portfela funduszu inwestycyjnego na zmiany poziomu stopy procentowej, zgodnie z zasadą, że im wyższa wartość wskaźnika, tym większa wrażliwość ceny obligacji na zmiany stop procentowych.

W ramach platformy **METLIFE**
05. FUNDUSZE AKCJI ZAGRANICZNYCH

FUNDUSZE	KODY UFK	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR	PW**
		3 M	12 M	36 M			
INVESTOR AKCJI	106	7,14	-3,39	27,44	0,13	0,21	TAK
BLACKROCK GLOBAL ALLOCATION FUND	085	1,99	-1,24	BD	BD	BD	NIE
SKARBIEC SPÓŁEK WZROSTOWYCH	080	6,66	-8,32	16,58	0,08	0,08	TAK
BLACKROCK LATIN AMERICAN FUND	110	4,26	3,97	-17,14	-0,15	0,22	NIE
BLACKROCK WORLD MINING FUND	109	9,93	18,57	-24,55	-0,06	-0,06	NIE
FRANKLIN GLOBAL FUNDAMENTAL STRATEGIES	074	-0,35	-6,98	BD	BD	BD	NIE
FRANKLIN NATURAL RESOURCES	111	-3,85	-3,58	BD	BD	BD	NIE
FRANKLIN US OPPORTUNITIERS FUND	073	5,36	-7,58	BD	BD	BD	NIE
JPMORGAN EMERGING MARKETS OPORTUNITIES	118	9,65	2,75	BD	BD	BD	TAK
JPMORGAN GLOBAL HEALTHCARE	112	6,63	-14,31	BD	BD	BD	NIE
JPMORGAN HIGHBRIDGE US STEEP	121	6,61	-1,32	BD	BD	BD	NIE
METLIFE AKCJI AMERYKAŃSKICH	065	4,46	0,51	45,01	0,26	0,32	TAK
METLIFE AKCJI CHIŃSKICH I AZJATYCKICH	123	5,25	-0,09	41,85	0,23	0,08	TAK
METLIFE AKCJI RYNKÓW ROZWIINIĘTYCH	066	4,29	2,67	28,3	0,19	0,15	TAK
METLIFE AKCJI RYNKÓW WSCHODZĄCYCH	068	5,79	1,11	11,99	0,06	0,24	TAK
SCHRODER IFS ASIAN OPPORTUNITIES	086	9,01	3,31	BD	BD	BD	NIE
SCHRODER IFS EURO EQUITY	087	0,02	-9,19	BD	BD	BD	NIE
SCHRODER IFS FRONTIER MARKETS EQUITY	113	5,18	-7,2	BD	BD	BD	NIE

06. FUNDUSZE OBLIGACJI ZAGRANICZNYCH

FUNDUSZE	KODY UFK	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR	PW**
		3 M	12 M	36 M			
BLACKROCK FIXED INCOME GLOBAL OPPORTUNIT.	116	1,6	1,04	11,33	0,09	0,02	NIE
BLACKROCK GLOBAL HIGH YIELD BOND	117	3,12	1,49	BD	BD	BD	NIE
JPMORGAN GLOBAL STRATEGIC BOND	120	2,19	2,09	BD	BD	BD	NIE
JPMORGAN GLOBAL HIGH YIELD BOND	076	3,95	3,44	BD	BD	BD	NIE
TEMPLETON GLOBAL BOND	072	-1,44	-6,61	BD	BD	BD	NIE
TEMPLETON GLOBAL TOTAL RETURN	075	-0,54	-5,05	BD	BD	BD	NIE

źródło: Analizy On-Line, TFI i opracowania własne

Zastrzeżenia prawne:

Niniejszy dokument został przygotowany przez Phinance S.A. (Phinance) zgodnie ze stanem na dzień 24.11.2015 r. 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.

**PW (Pozycja Walutowa) określa czy w przypadku ekspozycji funduszu inwestycyjnego na zagraniczne instrumenty finansowe, inwestycja realizowana przez fundusz inwestycyjny narażona jest, obok ryzyka inwestycyjnego, na ryzyko zmian kursu walutowego. W przypadku braku Pozycji Walutowej (PW = NIE) niewielkie zyski lub straty wynikające z ryzyka walutowego nie mogą zostać wykluczone.
 ***DURATION (czas trwania obligacji) określa stopień wrażliwości części obligacyjnej portfela funduszu inwestycyjnego na zmiany poziomu stopy procentowej, zgodnie z zasadą, że im wyższa wartość wskaźnika, tym większa wrażliwość ceny obligacji na zmiany stóp procentowych.