

W ramach platformy AEGON

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 chęci podejmowania ryzyka inwestycyjnego.

01. FUNDUSZE AKCJI POLSKICH UNIWERSALNE

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
	3 M	12 M	36 M		
QUERCUS AGRESYWNY	-2,45	-5,88	1,4	-0,02	0,01
PKO AKCJI PLUS	-0,2	-7,09	8,85	0,05	0,06
AVIVA INVESTORS POLSKICH AKCJI	-1,78	-7,35	-0,35	-0,04	-0,01
ALLIANZ SELEKTYWNY	-3,05	-13,58	-1,14	-0,04	0,01
UNIKORONA AKCJE	-3,22	-10,36	-3,51	-0,05	-0,03
NOBLE FUND AKCJI	-3,52	-11,98	-8,79	-0,11	-0,19
LEGG MASON AKCJI	-2,88	-12,33	-10,12	-0,11	-0,05
SKARBIEC AKCJA	0,81	-13,66	-11,89	-0,12	-0,07
ARKA PRESTIŻ AKCJI POLSKICH	-0,72	-8,24	10,97	0,05	0,08

02. FUNDUSZE POLSKICH AKCJI MAŁYCH I ŚREDNICH SPÓŁEK

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
	3 M	12 M	36 M		
SKARBIEC MAŁYCH I ŚREDNICH SPÓŁEK	2,54	-3,22	12,95	0,07	0
NOBLE FUND AKCJI MIŚS	0,7	-2,98	10,54	0,05	-0,02
INVESTOR TOP 25 MAŁYCH SPÓŁEK	5,31	-3,57	12,99	0,07	0
AVIVA INVESTORS NOWYCH SPÓŁEK	-1,48	-2,23	13,33	0,05	0,07
PZU AKCJI MAŁYCH I ŚREDNICH SPÓŁEK	-0,98	-1,92	4,25	0,01	-0,04

03. FUNDUSZE AKCYJNE ZAGRANICZNE

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR	PW**
	3 M	12 M	36 M			
INVESTOR AKCJI	7,14	-3,39	27,44	0,13	0,21	TAK
FRANKLIN U.S. OPPORTUNITIES	7,89	-9,9	44,84	0,26	0,04	TAK
JP MORGAN EUROPE EQUITY PLUS	-1,21	-12,92	25,41	0,18	0,05	TAK
BLACKROCK EUROPEAN VALUE	-1,82	-13,65	21	0,16	0,1	TAK
FRANKLIN EUROPEAN SMALL MID CAP GROWTH	-9,32	-17,28	12,85	0,11	-0,03	TAK
NN (L) GLOBALNY SPÓŁEK DYWIDENDOWYCH	3,28	-6,55	26,98	0,18	0,05	TAK
SCHRODER GLOBAL SMALLER COMPANIES	5,09	-2,65	BD	BD	BD	TAK
JP MORGAN JAPAN STRATEGIC VALUE	3,3	-9,62	16,16	0,13	-0,02	TAK
SCHRODER US SMALL MID CAP EQUITY	4,77	3,26	32,44	0,25	0,25	TAK
ALLIANZ EUROPE EQUITY GROWTH	3,26	-4,81	31,39	0,2	0,1	TAK
FIDELITY GREATER CHINA	10,02	-3,69	42,4	0,22	0,2	TAK
JP MORGAN HIGHBRIDGE US STEEP FUND	6,45	-2,11	BD	BD	BD	TAK
FRANKLIN EUROPEAN GROWTH	1,01	-11,66	3,58	0,06	-0,07	TAK
FRANKLIN INDIA	10,16	0,8	67,04	0,18	-0,02	NIE
BLACKROCK GLOBAL SMALL CAP	4,79	-6,56	8,03	0,07	-0,04	TAK
FIDELITY EMERGING MARKETS	8,82	-1,47	23,62	0,17	0,16	TAK
SCHRODER GLOBAL DEMOGRAPHICS OPPORTUNITIES	3,98	-2,08	B.D.	B.D.	B.D.	TAK
FRANKLIN GLOBAL SMALL MID CAP	-5,42	-9,33	-1,16	0,02	-0,03	TAK
JP MORGAN GREATER CHINA	6,96	-7,08	9,44	0,07	0,03	TAK
JP MORGAN ASEAN EQUITY	9,84	5,3	12,92	0,1	-0,08	TAK
ALLIANZ GLOBAL EQUITY	3,04	-2,24	14,99	0,24	0,05	TAK
AEGON CENTRAL EUROPEAN EQUITY	-1,57	-11,36	-0,4	0,03	B.D.	TAK

**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 AEGON

03. FUNDUSZE AKCYJNE ZAGRANICZNE

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU					
	3 M	12 M	36 M	SHARP	IR	PW**
TEMPLETON ASIAN GROWTH	6,24	-5,32	-10,38	-0,08	-0,13	NIE
AEGON AKCJI ROSYJSKICH	0,11	9,09	-7,75	-0,02	B.D.	TAK
AEGON AKCJI TURECKICH	-12,13	-3,29	-13,62	-0,04	B.D.	TAK
BLACKROCK EMERGING MARKETS	8,66	0,49	-4,59	-0,01	-0,06	TAK
FIDELITY LATIN AMERICA	7,59	3,47	-9,79	-0,01	0,06	TAK
TEMPLETON LATIN AMERICA	4,95	10,97	-23,3	-0,1	-0,02	NIE
FIDELITY ASEAN	5,94	3,46	-6,06	-0,03	B.D.	TAK
FIDELITY AMERICA	5,55	1,99	36,09	0,27	0,4	TAK

04. FUNDUSZE OBLIGACJI POLSKICH

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR	INSTRUMENTY BEZPIECZNE*	DURATION ***
	3 M	12 M	36 M				
UNIWIBID PLUS	0,47	2,11	8,9	0,91	-0,18	0	ND
UNIOBLIGACJE AKTYWNY	0,89	3,34	18,38	0,24	0,13	58	5,17
AVIVA DŁUŻNYCH PAP. KORPOR.	1,87	3,6	11,12	0,32	0,06	8	1,91
ARKA OBLIGACJI SKARBOWYCH	1	2,61	9,82	0,1	0,03	95	BD
AVIVA INVESTORS OBLIGACJI	0,51	2,24	8,1	0,06	-0,21	95	2,87
PKO PAPIERÓW DŁUŻNYCH PLUS	0,35	2,14	7,76	0,05	-0,16	79	BD
ARKA PRESTIŻ OBLIGACJI KORP.	0,93	2,14	10,31	0,34	0,03	29	BD
AEGON POLISH BOND	0,92	2,81	B.D.	B.D.	B.D.	85	BD

05. FUNDUSZE OBLIGACJI ZAGRANICZNYCH

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU					
	3 M	12 M	36 M	SHARP	IR	PW**
JP MORGAN US BOND	2,35	4,47	BD	BD	BD	TAK
JP MORGAN GLOBAL HIGH YELD BOND USD	3,95	3,44	BD	BD	BD	NIE
UNI EURIBOR EUR	0,25	0,77	2,67	0,77	B.D.	TAK
FRANKLIN STRATEGIC INCOME	3,08	1,66	BD	BD	BD	TAK
TEMPLETON GLOBAL TOTAL RETURN USD	-0,89	-6,75	-6,82	-0,1	-0,14	TAK
TEMPLETON GLOBAL TOTAL RETURN EUR	1,66	-8,26	10,22	0,12	-0,2	TAK
HSBC GLOBAL EMERGING MARKETS BOND USD	3,71	7,21	12,81	0,17	0,1	TAK
FIDELITY EUROPEAN HIGH YIELD	2,31	3,43	13,17	0,25	BD	TAK
BLACKROCK FIXED INCOME GLOBAL OPPORTUNITIES	1,6	1,04	BD	BD	BD	NIE
CREDIT SUISSE BOND HIGH YIELD	5,64	-0,74	BD	BD	BD	TAK

06. FUNDUSZE RYNKU PIENIĘŻNEGO

FUNDUSZE	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR	INSTRUMENTY BEZPIECZNE*
	3 M	12 M	36 M			
UNIKORONA PIENIĘŻNY	0,69	1,88	9,4	0,34	0,38	46
PKO SKARBOWY	0,48	1,87	6,93	0,09	0,02	85
ALLIANZ PIENIĘŻNY	0,63	1,15	6,57	0,03	-0,01	54
AEGON BEZPIECZNY PIENIĘŻNY	0,21	0,88	BD	BD	BD	55

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 (Pozywa 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 Pozywy 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.