

W ramach platformy SKANDIA

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 AKCJI POLSKICH UNIWERSALNE

FUNDUSZE	KODY UFK	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
		3 M	12 M	36 M		
QUERCUS AGRESYWNY	QUE1	-2,45	-5,88	1,4	-0,02	0,01
OPTIMUM AKCJI	OPT3	-5,43	-20,46	BD	BD	BD
NN AKCJI	ING3	-3,46	-11,12	0,89	-0,02	0,02
AVIVA INVESTORS POLSKICH AKCJI	CU3	-1,78	-7,35	-0,35	-0,04	-0,01
UNIKORONA AKCJE	UNK3	-3,22	-10,36	-3,51	-0,05	-0,03
NOBLE FUND AKCJI	NB3	-3,52	-11,98	-8,79	-0,11	-0,19

02. FUNDUSZE AKCJI DUŻYCH SPÓŁEK

FUNDUSZE	KODY UFK	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
		3 M	12 M	36 M		
INVESTOR AKCJI SPÓŁEK DYWIDENDOWYCH	DWS3	-2,91	-16,3	-12,67	-0,16	-0,07
SKARBIEC AKCJA	SKAR3	0,81	-13,66	-11,89	-0,12	-0,07

03. FUNDUSZE AKCJI MAŁYCH I ŚREDNICH SPÓŁEK

FUNDUSZE	KODY UFK	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
		3 M	12 M	36 M		
NOBLE FUND AKCJI MIŚS	NB4	0,7	-2,98	10,54	0,05	-0,02
UNI AKCJE MAŁYCH I ŚREDNICH SPÓŁEK	UNK6	0,13	-3,56	11,42	0,06	-0,07
AVIVA INVESTORS MAŁYCH SPÓŁEK	CU1	-1,99	-1,82	4,17	0,01	-0,07

04. FUNDUSZE AKCJI ZAGRANICZNYCH

FUNDUSZE	KODY UFK	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR	PW**
		3 M	12 M	36 M			
JB EUROPE SMALL MID CAP STOC FUND	JB2	0,27	-7,38	35,75	0,25	0,16	TAK
JP MORGAN EUROPE EQUITY FUND	JPM1	-0,52	-11,8	23,15	0,17	0,05	TAK
TEMPLETON GROWTH (EURO) FUND	TEMP2	1,81	-10,33	18,49	0,16	-0,03	TAK
BLACKROCK GLOBAL US BASIC VALUE FUND	ML2	2,86	-3,51	15,02	0,12	-0,09	TAK
JP MOGRAN HIGHBRIDGE US STEEP FUND	JPM4	6,61	-1,32	BD	BD	BD	NIE
BLACKROCK GLOBAL OPPORTUNITIES FUND	ML1	3,89	-4,91	7,79	0,07	-0,06	TAK
NN AKCJI ŚRODKOWOEUROPEJSKICH	ING5A	-8,73	-9,26	2,06	-0,01	0,03	TAK
HSBC GIF CHINESE EQUITY	HSBC1	6,45	-8,59	13,04	0,08	0,01	TAK
HSBC GIF INDIAN EQUITY	HSBC4	9,95	-7,91	40,65	0,16	-0,08	TAK
TEMPLETON FRONTIER MARKETS	TEMP7	1,62	-8,98	-10,48	-0,07	-0,04	TAK
BLACKROCK GF EMERGING EUROPE FUND	ML3	-1,31	-1,93	-9,18	-0,02	0,07	TAK
BLACKROCK GLOBAL LATIN AMERICAN FUND	ML7	4,67	3,63	-19,08	-0,05	0,15	TAK
UNI AKCJE TURCJA	UNK9	-12,02	-6,23	-21,57	-0,08	-0,23	TAK
INVESTOR TURCJA	DWS8	-14,6	-8,52	-15,68	-0,05	-0,01	TAK
ALTUS ABSOLUTNEJ ST. ZW. NOWEJ EUROPY	ALT3	-0,87	1,74	BD	BD	BD	TAK
INVESTOR INDIE I CHINY	DWS6	7,25	-7,35	27,67	0,15	0,01	TAK
SCHRODER ISF ASIAN OPPORTUNITIES	SCH6	9,01	BD	BD	BD	BD	NIE
NN JAPONIA (L)	ING7	-2,86	-23,66	7,91	0,06	-0,01	TAK
HSBC GIF EUROLAND EQUITY SMAL. COMPAN.	HSBC2	-0,62	-6,27	35,8	0,23	-0,01	TAK
SCHRODER ISF EURO EQUITY	SCH7	0,02	BD	BD	BD	BD	NIE
FRANKLIN US OPPORTUNITIES	TEMP8	5,36	BD	BD	BD	BD	NIE
INVESTOR INFRASTRUKTURY I INFORMATYKI	DWS9	9,03	1,64	44,64	0,24	0,09	TAK
BLACKROCK GF WORLD HEALTHSCIENCE	ML9	7,78	3,58	44,56	0,31	0,2	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 SKANDIA

05. FUNDUSZE INDEKSOWE

FUNDUSZE	KODY UFK	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
		3 M	12 M	36 M		
QUERCUS LEV	QUE2	-11,38	-38,64	-47,6	-0,2	-0,13
QUERCUS SHORT	QUE3	3,72	15,27	9,19	0,04	0,05

06. FUNDUSZE AKTYWNEJ ALOKACJI

FUNDUSZE	KODY UFK	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR
		3 M	12 M	36 M		
ALTUS ABSOLUTNEJ ST. ZW. RYNKU POLSKIEGO	ALT1	-0,73	5,75	10,87	0,18	0,08
NOBLE FUND TIMINGOWY	NB7	-0,51	-0,85	2,57	-0,2	0,11

07. FUNDUSZE OBLIGACJI POLSKICH SKARBOWE

FUNDUSZE	KODY UFK	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR	INSTRUMENTY BEZPIECZNE*	DURATION***
		3 M	12 M	36 M				
OPTIMUM OBLIGACJI	OPT2	0,39	0,58	BD	BD	BD	79	BD
INSTR. DL. SKARBIEC OBLIGACJA	SKAR2	1,12	2,41	11,13	0,17	0,09	82	BD
INVESTOR OBLIGACJI	DWS2	1,39	3,69	10,54	0,17	0,01	64	3,45
NN OBLIGACJI	ING2	1,33	4,16	11,52	0,13	0,13	89	BD
AVIVA INVESTORS OBLIGACJI	CU2	0,51	2,24	8,1	0,06	-0,21	95	2,87

08. FUNDUSZE OBLIGACJI POLSKICH KORPORACYJNE I POZOSTALE

FUNDUSZE	KODY UFK	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR	INSTRUMENTY BEZPIECZNE*	DURATION***
		3 M	12 M	36 M				
ARKA OBLIGACJI SKARB.	ARKA2	1	2,61	9,82	0,1	0,03	95	BD
ALTUS ABS. ST. ZW. DLUZNY	ALT2	0,01	2,92	13,46	0,32	BD	90	BD
UNIKORONA OBLIGACJE	UNK2	0,25	1,52	8,66	0,1	-0,23	86	3,22

09. FUNDUSZE OBLIGACJI ZAGRANICZNYCH

FUNDUSZE	KODY UFK	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR	PW**
		3 M	12 M	36 M			
FRANKLIN EUROPEAN TOTAL RETURN FUND	TEMP5	2,96	4,37	19,73	0,41	0,05	TAK
UNIOBLIGACJE NOWA EUROPA	UNK8	0,33	7,58	17,84	0,13	0,2	TAK
TEMPLETON GLOBAL TOTAL RETURN	TEMP6	-0,54	-5,05	0,05	-0,08	-0,04	NIE
JULIUS BAER DOLLAR BOND FUND	JB1	2,35	5,23	10,46	0,29	B.D.	TAK

10. FUNDUSZE RYNKU PIENIĘŻNEGO SKARBOWE

FUNDUSZE	KODY UFK	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR	INSTRUMENTY BEZPIECZNE*
		3 M	12 M	36 M			
NN GOTÓWKOWY	ING4	0,12	0,92	5,18	0,16	-0,16	99

11. FUNDUSZE RYNKU PIENIĘŻNEGO KORPORACYJNE I POZOSTALE

FUNDUSZE	KODY UFK	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR	INSTRUMENTY BEZPIECZNE*
		3 M	12 M	36 M			
UNIKORONA PIENIĘŻNY	UNK4	0,69	1,88	9,4	0,34	0,38	46
UNIWIBID PLUS	UNK5	0,47	2,11	8,9	0,91	-0,18	0
LEGG MASON PIENIĘŻNY	KAHA4	0,22	1,36	5,85	-0,14	-0,12	62
OPTIMUM GOTÓWKOWY	OPT1	0	-0,78	BD	BD	BD	92
SKARBIEC KASA	SKAR4	0,36	1,34	5,44	-0,31	-0,2	60

12. METALE SZLACHETNE

FUNDUSZE	KODY UFK	% STOPY ZWROTU			SHARP	IR	PW**
		3 M	12 M	36 M			
INVESTOR GOLD OTWARTY	DWS5	9,36	25,87	10,59	0,04	0,11	TAK
BLACKROCK WORLD GOLD	ML5	22,79	102,62	28	0,11	0,18	TAK

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.