

STOPY ZWROTU STRATEGII ASSET MANAGEMENT

NAZWA FIRMY ASSET MANAGEMENT	NAZWA PORTFELA/STRATEGII	STOPA ZWROTU BRUTTO Z PORTFELA (PROC.)							NAZWA STOSOWANEGO BENCHMARKU	STOPA ZWROTU Z BENCHMARKU (PROC.)		
		październik- grudzień 2016 r. (kwar- talna)	Różnica z bench- markiem (pkt proc.)	styczeń 2016- grudzień 2016 r. (roczna)	Różnica z bench- markiem (pkt proc.)	Trzy- letnia stopa zwrotu	Różnica z bench- markiem (pkt proc.)	Pięcio- letnia stopa zwrotu (jeżeli możliwe)		październik- grudzień 2016 r. (kwar- talna)	styczeń 2016- grudzień 2016 r. (roczna)	Trzy- letnia stopa zwrotu
Portfele akcji												
mBank Asset Management	Strategia Agresywna	9,27	-4,68	21,97	17,20	49,06	67,93	117,25	WIG20	13,95	4,77	-18,87
EFIX Dom Maklerski	Dynamiczne Spółki – Portfel Małych i Średnich Spółek	3,26	-1,34	20,06	1,88	33,98	7,97	135,72	mWIG40	4,60	18,18	26,01
Skarbiec TFI	Strategia Agresywna	8,87	-5,08	18,00	13,23	-0,52	18,35	51,99	WIG20	13,95	4,77	-18,87
mBank Asset Management	Portfel Modelowy Agresywny	8,08	-2,20	17,91	11,71	15,56	18,66	75,84	WIG20 60 proc. + WIBID O/N 20 proc. + MSCI ACWI 20 proc.	10,28	6,20	-3,10
mBank Asset Management	Strategia Akcyjna	5,79	-5,35	15,76	11,40	20,36	34,34	b.d.	WIG20 80 proc. + WIBID O/N 20 proc.	11,14	4,36	-13,98
mBank Asset Management	Strategia Agresywna Małych i Średnich Spółek	2,44	0,57	14,34	1,25	21,84	9,49	b.d.	50 proc. sWIG80 + 50 proc. mWIG40	1,87	13,09	12,35
Pioneer Pekao TFI	Portfel z udziałem akcji od 90 proc. do 100 proc. małych i średnich spółek	1,92	-2,68	14,10	-4,08	18,48	-7,53	88,11	mWIG40	4,60	18,18	26,01
Dom Maklerski BDM	Fundamentalny	2,80	-11,15	13,41	8,64	7,41	26,28	44,80	WIG20	13,95	4,77	-18,87
Quercus TFI	Strategia Akcyjna	5,20	-4,72	11,81	0,43	34,35	33,43	152,36	WIG	9,92	11,38	0,92
Pioneer Pekao TFI	Portfel z udziałem akcji od 90 proc. do 100 proc.	7,17	-2,75	11,80	0,42	5,58	4,66	51,28	WIG	9,92	11,38	0,92
Money Makers TFI	Akcji	6,07	-2,87	11,60	1,12	-4,62	-6,30	37,01	10 proc. WIBID_1Y + 90 proc. WIG	8,95	10,48	1,68
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Małych i Średnich Spółek	1,87	-2,73	10,60	-7,59	3,21	-22,81	50,74	mWIG40	4,60	18,19	26,02
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Akcyjny	6,82	-7,13	10,52	5,74	-4,38	14,48	33,01	WIG20	13,95	4,78	-18,86
EFIX Dom Maklerski	Strategia Dywidendowa	1,66	1,27	7,53	5,94	b.d.	b.d.	b.d.	WIBID 1Y	0,39	1,59	b.d.
Dom Maklerski BDM	Agresywny	3,58	-10,37	6,36	1,59	-3,58	15,29	33,35	WIG20	13,95	4,77	-18,87
KBC TFI	KBC Portfel VIP SFIO (Portfel Dynamiczny Plus)	4,81	-4,45	6,24	2,92	-0,43	18,84	34,34	42 proc. WIG20 + 18 proc. EuroStoxx50 + 28 proc. mWIG40 + 12 proc. sWIG80	9,26	3,32	-19,27
Legg Mason TFI	Akcyjne – Skorelowane	2,79	-7,13	5,08	-6,30	-10,58	-11,50	19,77	WIG	9,92	11,38	0,92
Portfele akcji rynków zagranicznych												
Caspar Asset Management	Strategia Akcji Spółek Strefy Euro	10,69	-0,14	15,49	11,04	b.d.	b.d.	b.d.	MSCI EMU EUR Net Total Return Index (M7EM)	10,83	4,45	b.d.
Caspar Asset Management	Strategia Akcji Skoncentrowanych	7,32	-0,17	13,60	4,55	b.d.	b.d.	b.d.	50 proc. MSCI Germany Index (USD) net (NDDUGR) + 20 proc. MSCI Poland Index (USD) net (NDEUSPO) + 20 proc. MSCI Turkey Index (USD) net (NDEUTUR) + 6 proc. MSCI Austria Index (USD) net (NDDUAT) + 2 proc. MSCI Czech Republic Index (USD) net (NDEUSCZ) + 2 proc. MSCI Hungary Index (USD) net (NDEUSHG)	7,49	9,05	b.d.
Caspar Asset Management	Strategia Akcyjna Środkowej i Wschodniej Europy	6,52	-1,02	12,19	-0,04	23,75	7,27	70,51	25 proc. WIG (Polska) + 25 proc. ATXTR (Austria) + 25 proc. XU100T (Turcja) + 12,5 proc. BUX (Węgry) + 12,5 proc. PX (Czechy)	7,54	12,23	16,48
Portfele mieszane – zrównoważone (udział akcji od 65 proc.)												
Money Makers TFI	Agresywnego Wzrostu	5,63	-2,36	10,16	0,59	-1,27	-3,66	34,19	20 proc. WIBID_1Y + 80 proc. WIG	7,99	9,57	2,38
Money Makers TFI	Wzrostu	4,64	-2,38	9,20	0,57	-1,64	-4,66	28,56	30 proc. WIBID_1Y + 70 proc. WIG	7,02	8,63	3,02
Pioneer Pekao TFI	Portfel z udziałem akcji od 60 proc. do 80 proc.	5,57	-1,27	8,97	0,52	6,99	3,28	44,93	70 proc. WIG + 30 proc. CPGBL_1_3	6,84	8,45	3,71
KBC TFI	KBC Portfel VIP SFIO (Portfel Dynamiczny)	5,31	-3,96	2,42	1,96	-5,96	14,97	13,43	53 proc. WIG20 + 22 proc. EuroStoxx50 + 25 proc. PLSI	9,28	0,46	-20,93
Portfele mieszane – zrównoważone (udział akcji od 40 do 65 proc.)												
mBank Asset Management	Portfel Modelowy Zrównoważonego Wzrostu	5,35	-0,49	11,75	7,75	12,00	11,27	58,50	WIG20 40 proc. + WIBID O/N 20 proc. + MSCI ACWI 10 proc. + Bloomberg/EFFAS Bonds Indices, Poland Govt All > 1 Yr 30 proc.	5,84	4,00	0,73
Skarbiec TFI	Strategia Zrównoważona	3,52	-1,83	9,61	6,47	6,90	9,32	35,30	40 proc. WIG20 + 60 proc. Citigroup Poland GBI 1 to 3 Year Local Terms	5,35	3,14	-2,42
mBank Asset Management	Strategia Konserwatywna	1,92	-4,23	9,26	4,22	11,80	11,24	37,76	WIG20 40 proc. + B5S2 60 proc.	6,15	5,04	0,56
mBank Asset Management	Strategia Mieszana	2,21	-3,48	8,10	4,86	11,35	15,39	b.d.	WIBID 3M 60 proc. + WIG20 40 proc.	5,69	3,24	-4,04
Ipopema TFI	Portfel Zrównoważony	2,58	-0,58	6,78	1,75	9,35	2,66	35,78	40 proc. WIG + 60 proc. Polskich Obligacji Bloomberg/EFFAS 1-7	3,16	5,03	6,69
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Zrównoważony	4,42	-2,75	6,50	3,33	-4,93	-1,48	21,14	50 proc. WIG20 + 50 proc. BS-52	7,17	3,17	-3,45
Money Makers TFI	Zrównoważona	3,23	-1,88	6,47	-0,24	-1,07	-5,19	24,04	50 proc. WIBID_1Y + 50 proc. WIG	5,11	6,71	4,12
Pioneer Pekao TFI	Portfel z udziałem akcji od 40 proc. do 60 proc.	3,62	-1,19	6,40	-0,01	7,36	2,08	36,91	50 proc. WIG + 50 proc. CPGBL_1_3	4,81	6,41	5,28
Pioneer Pekao TFI	Portfel z udziałem akcji od 30 proc. do 50 proc.	2,96	-0,85	4,96	-0,40	6,33	0,36	31,23	40 proc. WIG + 60 proc. CPGBL_1_3	3,81	5,36	5,97
Money Makers TFI	Zrównoważona Stałego Dochodu	3,13	-1,03	4,72	-1,00	-0,98	-5,55	11,91	60 proc. WIBID_1Y + 40 proc. WIG	4,16	5,72	4,57
KBC TFI	KBC Portfel VIP SFIO (Portfel Zrównoważony Plus)	2,61	-1,15	4,11	2,74	6,50	14,72	34,16	21 proc. WIG20 + 9 proc. EuroStoxx50 + 14 proc. mWIG40 + 6 proc. sWIG80 + 50 proc. PLSI	3,76	1,38	-8,22
KBC TFI	KBC Portfel VIP SFIO (Portfel Zrównoważony)	2,99	-1,09	2,36	2,41	2,70	12,98	21,32	28 proc. WIG20 + 12 proc. EuroStoxx50 + 60 proc. PLSI	4,08	-0,04	-10,28
Portfele mieszane aktywów zagranicznych – zrównoważone (udział akcji od 40 do 65 proc.)												
Caspar Asset Management	Strategia Zrównoważona Środkowej i Wschodniej Europy	3,10	-0,82	6,82	0,85	13,96	6,55	37,12	50 proc. benchmarku dla Strategii Akcyjnej Środkowej i Wschodniej Europy oraz 50 proc. benchmarku opartego na miesięcznym wskaźniku cen towarów i usług konsumpcyjnych publikowanego przez GUS	3,92	5,97	7,41
Portfele mieszane – stabilnego wzrostu (udział akcji do 40 proc.)												
mBank Asset Management	Portfel Modelowy Stabilnego Wzrostu	5,48	3,37	10,26	7,94	13,78	8,14	53,24	WIG20 20 proc. + WIBID O/N 20 proc. + MSCI ACWI 5 proc. + Bloomberg/EFFAS Bonds Indices, Poland Govt All > 1 Yr 55 proc.	2,11	2,32	5,64
Dom Maklerski BDM	Zrównoważony	2,61	-3,21	8,71	5,84	3,35	7,63	26,52	40 proc. WIG20 + 60 proc. WIBID 1Y	5,82	2,87	-4,28
Ipopema TFI	Portfel Stabilnego Wzrostu	1,93	-0,18	6,36	2,08	11,59	2,18	35,82	65 proc. EFFAS All >1 Yr + 35 proc. indeks WIG	2,11	4,28	9,41
mBank Asset Management	Strategia Dochodowa	0,31	-2,05	5,43	3,21	10,60	8,64	28,73	WIBID 3M 85 proc. + WIG20 15 proc.	2,36	2,22	1,96
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Stabilnego Wzrostu	3,17	-1,29	4,63	2,10	1,57	-1,15	18,45	30 proc. WIG20 + 70 proc. BS-52	4,46	2,53	2,72
Money Makers TFI	Stabilnego Wzrostu	1,51	-1,71	4,61	-0,11	1,93	-3,03	18,02	70 proc. WIBID_1Y + 30 proc. WIG	3,22	4,72	4,96
Pioneer Pekao TFI	Portfel z udziałem akcji od 20 proc. do 40 proc.	2,17	-0,64	3,88	-0,43	6,52	-0,08	27,54	30 proc. WIG + 70 proc. CPGBL_1_3	2,81	4,31	6,60
Skarbiec TFI	Strategia Dochodowa	1,51	-0,38	3,69	1,77	4,54	0,29	21,64	15 proc. WIG20 + 85 proc. Citigroup Poland GBI 1 to 3 Year Local Terms	1,89	1,92	4,25
Pioneer Pekao TFI	Portfel z udziałem akcji od 10 proc. do 30 proc.	1,36	-0,45	2,84	-0,39	7,10	-0,07	24,94	20 proc. WIG + 80 proc. CPGBL_1_3	1,81	3,23	7,17
KBC TFI	KBC Portfel VIP SFIO (Portfel Bezpieczny Plus)	0,89	0,34	2,52	2,53	11,75	13,19	33,81	8 proc. EuroStoxx50 + 4 proc. WIG20 + 6 proc. mWIG40 + 2 proc. sWIG80 + 80 proc. PLSI	0,56	-0,01	-1,44
KBC TFI	KBC Portfel VIP SFIO (Portfel Bezpieczny)	0,66	0,78	1,54	2,19	10,96	11,08	28,37	7 proc. WIG20 + 3 proc. EuroStoxx50 + 90 proc. PLSI	-0,12	-0,65	-0,11
Portfele mieszane aktywów zagranicznych – stabilnego wzrostu (udział akcji do 40 proc.)												
Caspar Asset Management	Strategia Stabilnego Wzrostu Środkowej i Wschodniej Europy	0,60	-1,51	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	25 proc. benchmarku dla Strategii Akcyjnej Środkowej i Wschodniej Europy oraz 75 proc. benchmarku opartego na miesięcznym wskaźniku cen towarów i usług konsumpcyjnych publikowanego przez GUS	2,11	b.d.	b.d.
Portfele o zmiennej alokacji aktywów												
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Aktywnej Alokacji	8,63	8,24	12,27	10,71	1,07	-10,90	37,98	WIBID 6M	0,39	1,56	11,97
Noble Funds TFI	Zmiennej Alokacji	7,44	2,91	10,83	6,30	9,81	-4,42	33,82	BS-52	4,53	4,53	14,23
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Zysk Absolutny	3,60	3,21	9,85	8,29	0,11	-11,86	28,83	WIBID 6M	0,39	1,56	11,97
mBank Asset Management	UFK Wielu Klas Aktywów	4,07	b.d.	8,93	b.d.	24,30	b.d.	b.d.	brak	b.d.	b.d.	b.d.
mBank Asset Management	Strategia Wielu Klas Aktywów	4,84	b.d.	7,02	b.d.	17,12	b.d.	69,28	brak	b.d.	b.d.	b.d.
Dom Mak												