

NAZWA FIRMY ASSET MANAGEMENT	NAZWA PORTFELA/STRATEGII	STOPA ZWROTU BRUTTO Z PORTFELA (PROC.)							NAZWA STOSOWANEGO BENCHMARKU	STOPA ZWROTU Z BENCHMARKU (PROC.)		
		październik- grudzień 2017 r. (kwarta- lna)	Różnica z bench- markiem (pkt proc.)	styczeń 2017- grudzień 2017 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 2017 r. (kwarta- lna)	styczeń- grudzień 2017- 2017 r. (roczna)	Trzy- letnia stopa zwrotu
KBC TFI	KBC Portfel VIP SFIO (Portfel Bezpieczny Plus)	0,21	0,60	6,58	2,79	10,40	9,44	23,16	8 proc. EuroStoxx50 + 4 proc. WIG20 + 6 proc. mWIG40 + 2 proc. sWIG80 + 80 proc. PLSI	-0,39	3,80	0,95
Superfund TFI	Strategia Konserwatywny Portfel	1,56	0,85	6,38	2,93	8,52	1,61	b.d.	5 proc. WIG + 60 proc. WIBID1M + 30 proc. Bloomberg/EFFAS Bond Indices Poland Govt All >1Yr TR + 5 proc. Credit Suisse Managed Futures Liquid Index (USD) minus koszty stałe	0,71	3,45	6,91
Superfund TFI	Strategia Konserwatywna	2,61	2,15	6,15	3,79	8,72	2,17	b.d.	5 proc. WIG + 90 proc. WIBID1M + 5 proc. Credit Suisse Managed Futures Liquid Index (USD) minus koszty stałe	0,46	2,36	6,55
mBank Asset Management	Portfel Modelowy Stabilnego Wzrostu	0,71	0,50	6,02	-2,58	21,67	14,57	40,99	WIG20 20 proc. + WIBID O/N 20 proc. + MSCI ACWI 5 proc. + Bloomberg/EFFAS Bonds Indices, Poland Govt All >1Yr 55 proc.	0,21	8,60	7,10
KBC TFI	KBC Portfel VIP SFIO (Portfel Bezpieczny)	0,54	0,19	5,58	1,37	8,43	7,23	18,68	7 proc. WIG20 + 3 proc. EuroStoxx50 + 90 proc. PLSI	0,34	4,21	1,20
mBank Asset Management	Strategia Dochodowa	0,04	-0,08	5,52	0,80	16,04	10,90	23,43	WIBID 3M 85 proc. + WIG20 15 proc.	0,12	4,72	5,14
DM BDM	Zrównoważony	-3,12	-3,50	0,92	-10,61	5,13	4,11	9,17	60 proc. WIBID1Y + 40 proc. WIG20	0,38	11,53	1,02
DM TMS Brokers	TMS Stable Growth	-4,57	-6,74	-3,90	-14,81	b.d.	b.d.	b.d.	30 proc. MSCI World + 70 proc. Bloomberg Global Developed Sovereign Bond Index	2,17	10,91	b.d.
Pioneer Pekao TFI	Portfel z udziałem akcji od 0 proc. do 20 proc.	0,53	0,02	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	10 proc. WIG + 90 proc. CPGB1_1_3	0,51	b.d.	b.d.
mBank Asset Management	Dochodowa 2.0	0,22	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	WIBID 3M + 1,5	b.d.	b.d.	b.d.
Portfele mieszane aktywów zagranicznych – stabilnego wzrostu (udział akcji do 40 proc.)												
BM BGŻ BNP Paribas	Stabilny Portfel Instrumentów Zagranicznych – USD	1,44	-0,13	9,93	1,59	b.d.	b.d.	b.d.	10 proc. GS Overnight Money Market USD + 43 proc. EFFAS Bond Indices US Govt All >1Yr TR + 22 proc. Bloomberg US Corporate Bond Index + 8 proc. STOXX Europe 600 + 10 proc. S&P500 + 1 proc. Topix + 6 proc. MSCI EM	1,57	8,34	b.d.
Caspar Asset Management	Strategia Stabilnego Wzrostu Środkowej i Wschodniej Europy	1,16	0,41	6,23	-0,50	b.d.	b.d.	b.d.	25 proc. benchmarku dla Strategii Akcyjnej Środkowej i Wschodniej Europy oraz 75 proc. benchmarku opartego na inflacji	0,75	6,73	b.d.
BM BGŻ BNP Paribas	Stabilny Portfel Instrumentów Zagranicznych – EUR	0,85	-0,19	3,44	1,31	b.d.	b.d.	b.d.	10 proc. EONIA + 43 proc. EFFAS Bond Euro Govt All >1Yr TR + 22 proc. FTSE Euro Corporate AA Index + 10 proc. STOXX Europe 600 + 8 proc. S&P500 + 1 proc. Topix + 6 proc. MSCI EM	1,04	2,13	b.d.
Portfele o zmiennej alokacji aktywów												
Noble Funds TFI	Zmiennej Alokacji	1,78	0,67	17,51	12,99	31,08	16,87	33,21	BS 52	1,11	4,52	14,21
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Aktywnej Alokacji	-2,00	-2,40	16,49	14,87	25,51	17,55	35,37	WIBID 6M	0,40	1,62	7,96
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Zysk Absolutny	-0,30	-0,70	13,21	11,59	22,88	14,92	29,58	WIBID 6M	0,40	1,62	7,96
Dom Maklerski Alfa Zarządzanie Aktywami	ETF 2	-0,08	-0,69	13,05	-4,67	11,06	4,58	10,58	60 proc. WIG20 + 40 proc. Bond Spot	0,61	17,72	6,48
Dom Maklerski Alfa Zarządzanie Aktywami	Strategia Alfa ETF Agresywna	0,12	0,20	12,92	-0,19	1,32-13,39	b.d.	b.d.	50 proc. WIG + 25 proc. TBSP + 25 proc. WIBID ON	-0,08	13,11	14,71
Dom Maklerski Alfa Zarządzanie Aktywami	ETF 1	-0,08	-0,69	12,83	-4,89	11,21	4,73	11,03	60 proc. WIG20 + 40 proc. Bond Spot	0,61	17,72	6,48
Dom Maklerski Alfa Zarządzanie Aktywami	ETF 4	-0,18	-0,82	12,50	-4,14	11,39	4,88	b.d.	55 proc. WIG20 + 45 proc. Bond Spot	0,65	16,64	6,51
RDM Wealth Management	Indywidualna Strategia – RDM 100	1,03	b.d.	11,95	b.d.	-4,32	b.d.	16,49	indywidualnie ustalone z klientami	b.d.	b.d.	b.d.
EFIX Dom Maklerski	Duże Spółki	-1,35	-1,76	11,59	9,94	18,15	12,98	b.d.	WIBID 1Y	0,41	1,65	5,17
Dom Maklerski Alfa Zarządzanie Aktywami	ETF 3	-0,09	-0,73	11,48	-5,16	10,73	4,22	b.d.	55 proc. WIG20 + 45 proc. Bond Spot	0,65	16,64	6,51
RDM Wealth Management	Indywidualna Strategia – RDM 80	1,43	b.d.	10,46	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	indywidualnie ustalone z klientami	b.d.	b.d.	b.d.
Dom Maklerski Alfa Zarządzanie Aktywami	ETF 6	0,28	-0,48	10,24	-3,17	b.d.	b.d.	b.d.	40 proc. WIG20 + 60 proc. Bond Spot	0,76	13,40	6,59
Dom Maklerski Alfa Zarządzanie Aktywami	Strategia Alfa ETF Dynamiczna	0,36	0,21	9,94	-0,14	2,27	-9,66	b.d.	35 proc. WIG + 32,5 proc. TBSP + 32,5 proc. WIBID ON	0,15	10,09	11,93
RDM Wealth Management	Indywidualna Strategia – RDM 70	1,72	b.d.	9,65	b.d.	12,24	b.d.	b.d.	indywidualnie ustalone z klientami	b.d.	b.d.	b.d.
Dom Maklerski Alfa Zarządzanie Aktywami	ETF 5	0,09	-0,63	9,65	-4,84	b.d.	b.d.	b.d.	45 proc. WIG20 + 55 proc. Bond Spot	0,72	14,48	6,56
Dom Maklerski Alfa Zarządzanie Aktywami	Strategia Alfa Selektywna Agresywna	0,64	0,72	9,62	-3,48	22,49	7,78	b.d.	50 proc. WIG + 25 proc. TBSP + 25 proc. WIBID ON	-0,08	13,11	14,71
RDM Wealth Management	Strategia Aktywnej Alokacji – RDM 50	1,13	b.d.	9,32	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	indywidualnie ustalone z klientami	b.d.	b.d.	b.d.
Money Makers TFI	Zmiennej Alokacji	-1,39	-3,04	8,46	6,81	1,48	-0,14	10,24	WIBID 1Y	1,65	1,65	1,62
Dom Maklerski Alfa Zarządzanie Aktywami	ETF 7	0,18	-0,62	8,19	-4,13	7,78	1,17	b.d.	35 proc. WIG20 + 65 proc. Bond Spot	0,79	12,32	6,61
Superfund TFI	Strategia PRP Portfel Absolutnej stopy zwrotu	0,09	-0,28	8,04	6,58	7,52	1,87	b.d.	WIBID 1M	0,37	1,46	5,65
Dom Maklerski Alfa Zarządzanie Aktywami	Strategia Alfa ETF Umiarkowana	0,73	0,35	8,00	0,93	3,72	-5,43	b.d.	20 proc. WIG + 40 proc. TBSP + 40 proc. WIBID ON	0,38	7,07	9,14
EFIX Dom Maklerski	Aktywne Fundusze – Portfel Zrównoważony	0,51	0,10	7,98	6,33	12,30	7,13	b.d.	WIBID 1Y	0,41	1,65	5,17
Dom Maklerski Alfa Zarządzanie Aktywami	Strategia Alfa Selektywna Dynamiczna	0,66	0,51	7,70	-2,39	16,59	4,66	b.d.	35 proc. WIG + 32,5 proc. TBSP + 32,5 proc. WIBID ON	0,15	10,09	11,93
RDM Wealth Management	Indywidualna Strategia – RDM 50	0,82	b.d.	7,14	b.d.	12,33	b.d.	39,63	indywidualnie ustalone z klientami	b.d.	b.d.	b.d.
Dom Maklerski Alfa Zarządzanie Aktywami	ETF 8	0,18	-0,69	6,93	-3,24	b.d.	b.d.	b.d.	25 proc. WIG20 + 75 proc. Bond Spot	0,87	10,17	6,67
RDM Wealth Management	Indywidualna Strategia – RDM 35	0,61	b.d.	6,91	b.d.	11,57	b.d.	36,81	indywidualnie ustalone z klientami	b.d.	b.d.	b.d.
Dom Maklerski Alfa Zarządzanie Aktywami	ETF 9	0,48	-0,43	6,55	-2,53	b.d.	b.d.	b.d.	20 proc. WIG20 + 80 proc. Bond Spot	0,90	9,09	6,69
Dom Maklerski Alfa Zarządzanie Aktywami	ETF 10	0,56	-0,38	5,57	-2,44	b.d.	b.d.	b.d.	15 proc. WIG20 + 85 proc. Bond Spot	0,94	8,01	6,72
Dom Maklerski Alfa Zarządzanie Aktywami	Strategia Alfa Selektywna Umiarkowana	0,65	0,27	5,51	-1,56	12,36	3,22	b.d.	20 proc. WIG + 40 proc. TBSP + 40 proc. WIBID ON	0,38	7,07	9,14
RDM Wealth Management	Indywidualna Strategia – RDM 20	0,47	b.d.	5,28	b.d.	8,69	b.d.	27,57	indywidualnie ustalone z klientami	b.d.	b.d.	b.d.
RDM Wealth Management	Strategia Aktywnej Alokacji – RDM 20	0,11	b.d.	5,13	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	indywidualnie ustalone z klientami	b.d.	b.d.	b.d.
mBank Asset Management	Strategia Wielu Klas Aktywów	-3,45	b.d.	3,91	b.d.	17,06	b.d.	28,59	brak	b.d.	b.d.	b.d.
mBank Asset Management	UFK Wielu Klas Aktywów	-3,79	b.d.	2,87	b.d.	20,40	b.d.	b.d.	brak	b.d.	b.d.	b.d.
DM TMS Brokers	TMS Global Return	-5,66	-6,42	-5,33	-8,36	b.d.	b.d.	b.d.	WIBID3M + 1,5 pp	0,76	3,03	b.d.
Portfele dłużne oraz rynku pieniężnego												
Money Makers TFI	Strategia Niskiego Ryzyka	0,69	-0,59	7,00	2,12	7,30	2,33	13,79	85 proc. WIBID_1Y + 15 proc. WIG	1,28	4,88	4,97
Dom Maklerski Alfa Zarządzanie Aktywami	Alfa Selektywna Dłużna	1,40	0,65	5,53	2,15	8,74	3,04	b.d.	60 proc. TBSP + 40 proc. WIBID ON	0,76	3,39	5,71
Dom Maklerski BOŚ	Portfel IKE/IKZE Ochrona	1,51	1,11	4,76	3,14	b.d.	b.d.	b.d.	WIBID6M	0,40	1,62	b.d.
KBC TFI	KBC Portfel VIP SFIO (Portfel Super Defensywny)	0,81	0,72	4,35	3,95	9,63	9,29	19,92	86 proc. WIBID3M + 14 proc. PLSI + 0,25 proc.	0,08	0,40	0,34
Everest Investment Management	Strategia Bezpieczna	0,81	0,40	4,33	2,70	b.d.	b.d.	b.d.	średnie oprocentowanie depozytów bankowych wg NBP	0,41	1,63	b.d.
mBank Asset Management	Stabilny Portfel Aktywów	1,40	b.d.	4,32	b.d.	7,70	b.d.	17,98	brak	b.d.	b.d.	b.d.
DM BDM	Bezpieczny	1,36	0,94	4,30	2,65	6,76	1,92	14,71	WIBID 1Y	0,42	1,65	4,84
KBC TFI	KBC Portfel VIP SFIO (Portfel Defensywny)	0,77	0,57	4,21	3,27	9,00	8,68	20,39	65 proc. WIBID3M + 35 proc. PLSI + 0,25 proc.	0,21	0,95	0,33
RDM Wealth Management	Indywidualna Strategia Dłużna	0,00	b.d.	4,13	b.d.	9,11	b.d.	27,94	indywidualnie ustalone z klientami	b.d.	b.d.	b.d.
BM BGŻ BNP Paribas	Portfel Instrumentów Dłużnych – PLN	0,92	-0,13	3,71	-1,06	6,10	b.d.	b.d.	TBSP Index	1,05	4,77	b.d.
Esaliens TFI	Portfele Papierów Dłużnych – Osoby Prawne	1,05	0,40	3,57	0,44	5,73	-0,90	15,32	SSB 1-3	0,65	3,13	6,63
RDM Wealth Management	Indywidualna Strategia Płynnościowa	0,25	b.d.	3,47	b.d.	8,33	b.d.	b.d.	indywidualnie ustalone z klientami	b.d.	b.d.	b.d.
mBank Asset Management	Strategia Skarbowa Plus	0,53	0,31	3,40	-0,31	0,00	-5,82	0,00	WIBID O/N x 0,9 33 proc. + Citigroup Poland GBI 67 proc.	0,22	3,71	5,82
Esaliens TFI	Portfele Rynku Pieniężnego	0,88	0,62	3,15	1,80	7,63	3,48	15,50	JP ELMi + Poland	0,26	1,35	4,15
Pioneer Pekao TFI	Portfel z udziałem instrumentów dłużnych do 100 proc.	0,70	0,05	3,11	-0,02	6,19	-0,45	14,53	CPGB1_1_3	0,65	3,13	6,64
Skarbiec TFI	Portfel funduszy – Strategia Płynnościowa	0,71	-0,05	3,09	0,14	8,44	2,67	13,81	100 proc. Skarbiec Kasa	0,76	2,95	5,77
Dom Maklerski BOŚ	Portfel Bezpieczny	0,71	0,31	1,54	-0,08	2,60	-5,36	7,94	WIBID6M	0,40	1,62	7,96
mBank Asset Management	Portfel Modelowy Konserwatywny	0,48	0,23	1,27	-2,91	8,93	b.d.	18,89	WIBID O/N 20 proc. Bloomberg + EFFAS Bonds Indices, Poland Govt All >1Yr 80 proc.	0,25	4,18	b.d.
mBank Asset Management	Ochrony Kapitału	0,91	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	WIBID 3M + 0,5	b.d.	b.d.	b.d.
Portfele alternatywne												
Athena Investments Dom Maklerski	Athena Spectrum	4,43	b.d.	19,67	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	brak	b.d.	b.d.	b.d.
Superfund TFI	Strategia Managed Futures	9,07	5,78	12,26	14,51	-4,22	-9,69	b.d.	100 proc. Credit Suisse Managed Futures Liquid Index (USD) minus koszty stałe	3,29	-2,25	5,47
mBank Asset Management	Aktywny Portfel Funduszy	-1,67	b.d.	10,74	b.d.	23,50	b.d.	30,07	brak	b.d.	b.d.	b.d.
Everest Investment Management	Strategia Bezpieczna Plus	0,37	-0,04	6,82	5,19	b.d.	b.d.	b.d.	średnie oprocentowanie depozytów bankowych wg NBP	0,41	1,63	b.d.
Everest Investment Management	Strategia Surowcowa	1,54	b.d.	-3,12	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	brak	b.d.	b.d.	b.d.
mBank Asset Management	MultiAsset	-3,56	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	b.d.	WIBID3M + 2,5	b.d.	b.d.	b.d.