

## Portfel akcji polskich na 2 miejscu w rankingu Gazety Giełdy Parkiet

Portfel akcji polskich zarządzany przez Quercus TFI S.A. zajął drugie miejsce w rankingu przygotowanym przez Gazetę Giełdy Parkiet z rocznym wynikiem (październik 2022 – wrzesień 2023 r.) na poziomie +43,58%.

Warto także podkreślić, że nasza Strategia Akcyjna osiągnęła najlepszy wynik na rynku w następujących okresach:

- ostatni kwartał,
- od początku br.,
- ostatnie 3 lata,
- ostatnie 5 lat.

WWW.PARKIET.COM  
27 listopada 2023, poniedziałek

ASSET MANAGEMENT

.11

### Stopy zwrotu strategii asset management

| NAZWA FIRMY<br>ASSET MANAGEMENT | NAZWA PORTFELA/STRATEGII               | STOPA ZWROTU BRUTTO Z PORTFELA (PROC.)      |                                                          |                                                  |                                                      |                                                  |                                                      |                                                  |                                      | NAZWA STOSOWANEGO BENCHMARKU                                                                                                                                                                                                                                                                          | STOPA ZWROTU<br>Z BENCHMARKU (PROC.)                     |                                                      |                                    |
|---------------------------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|----------------------------------------------------------|--------------------------------------------------|------------------------------------------------------|--------------------------------------------------|------------------------------------------------------|--------------------------------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------------|
|                                 |                                        | lipiec-<br>wrzesień<br>2023 r.<br>(kwartał) | styczeń-<br>wrzesień<br>2023 r.<br>(od początku<br>roku) | różnica<br>z bench-<br>markiem<br>(pkt<br>proc.) | październik<br>2022-<br>wrzesień<br>2023<br>(roczna) | różnica<br>z bench-<br>markiem<br>(pkt<br>proc.) | trzy-<br>letnia<br>stopa<br>zwrotu<br>(pkt<br>proc.) | różnica<br>z bench-<br>markiem<br>(pkt<br>proc.) | pięcio-<br>letnia<br>stopa<br>zwrotu |                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | styczeń-<br>wrzesień<br>2023 r.<br>(od początku<br>roku) | październik<br>2022-<br>wrzesień<br>2023<br>(roczna) | trzy-<br>letnia<br>stopa<br>zwrotu |
| Portfele akcji polskich         |                                        |                                             |                                                          |                                                  |                                                      |                                                  |                                                      |                                                  |                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                                          |                                                      |                                    |
| BM Banku BNP Paribas            | Akcji PLN                              | -3,40                                       | 18,56                                                    | 8,08                                             | 51,65                                                | 12,65                                            | 56,01                                                | 36,14                                            | 43,05                                | 70 proc. WIG20 + 30 proc. mWIG40                                                                                                                                                                                                                                                                      | 10,48                                                    | 39                                                   | 19,87                              |
| Quercus TFI                     | Strategia Akcyjna                      | 1,68                                        | 24,41                                                    | 10,60                                            | 43,58                                                | 1,32                                             | 79,37                                                | 47,02                                            | 87,01                                | WIG                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 13,81                                                    | 42,26                                                | 32,35                              |
| Dom Maklerski BOŚ               | Portfel akcyjny                        | -2,28                                       | 13,22                                                    | 8,03                                             | 36,01                                                | -0,01                                            | 28,09                                                | 17,71                                            | 8,23                                 | WIG20                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 5,19                                                     | 36,02                                                | 10,38                              |
| mBank Asset Management          | Małych i Średnich Spółek PL            | -2,47                                       | 21,28                                                    | 4,59                                             | 35,20                                                | 3,25                                             | 60,51                                                | 25,07                                            | b.d.                                 | 60 proc. mWIG40 + 30 proc. sWIG80 + 10 proc. POLONIA – 1 proc. p.a.                                                                                                                                                                                                                                   | 16,69                                                    | 31,95                                                | 35,44                              |
| Dom Maklerski BOŚ               | Portfel małych i średnich spółek       | -1,09                                       | 15,49                                                    | -2,69                                            | 29,58                                                | -9,72                                            | 16,77                                                | -20,54                                           | 10,68                                | mWIG40                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 18,18                                                    | 39,3                                                 | 37,31                              |
| Skarbiec TFI                    | Portfel funduszy – strategia agresywna | -1,69                                       | 15,70                                                    | -1,06                                            | 23,63                                                | -17,38                                           | -0,70                                                | -31,42                                           | 18,94                                | 40 proc. subfundusz Skarbiec Akcja + 40 proc. subfundusz Skarbiec Małych i Średnich Spółek + 20 proc. subfundusz Skarbiec Obligacja. Do końca 2022 r. obowiązywał benchmark: mediana stopy zwrotu funduszy akcji polskich uniwersalnych zgodnie z klasyfikacją funduszy nadaną przez Analityk Online. | 16,76                                                    | 41,01                                                | 30,72                              |

Na trzecim miejscu w swojej kategorii uplasowała się Strategia Dłużna Krótkoterminowa zarządzana przez Quercus TFI S.A. z wynikiem 12,00% za ostatni rok.

|                                        |                                                                |       |       |          |       |       |       |        |       |                                                                                                                                                                                                                                                                     |      |       |       |
|----------------------------------------|----------------------------------------------------------------|-------|-------|----------|-------|-------|-------|--------|-------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|-------|-------|
| Portfele dłużne oraz rynku pieniężnego |                                                                |       |       |          |       |       |       |        |       |                                                                                                                                                                                                                                                                     |      |       |       |
| BM Banku BNP Paribas                   | Konserwatywny PLN                                              | 2,39  | 10,75 | 0,83     | 14,25 | 0,40  | -1,98 | 3,15   | 12,77 | TBSP Indeks                                                                                                                                                                                                                                                         | 9,92 | 13,85 | -5,13 |
| Caspar Asset Management                | Specjalistyczna Strategia Polskich Obligacji Skarbowych 01     | 3,86  | 10,91 | 5,91     | 14,07 | 7,36  | 24,98 | 14,05  | b.d.  | Stopa referencyjna NBP                                                                                                                                                                                                                                              | 5    | 6,71  | 10,93 |
| Quercus TFI                            | Strategia Dłużna Krótkoterminowa                               | 2,30  | 7,68  | 2,48     | 12,00 | 4,95  | 12,11 | 0,13   | b.d.  | WBID 3M + 30 pkt. bazowych                                                                                                                                                                                                                                          | 5,2  | 7,05  | 11,98 |
| Caspar Asset Management                | Specjalistyczna Strategia Indywidualna Obligacji Skarbowych 02 | 2,38  | 8,04  | 3,04     | 9,96  | 3,25  | b.d.  | b.d.   | b.d.  | Stopa referencyjna NBP                                                                                                                                                                                                                                              | 5    | 6,71  | b.d.  |
| mBank Asset Management                 | Portfel Funduszy Konserwatywny*                                | 1,52  | 7,29  | 47299,09 | 9,81  | 8,58  | 5,19  | 3,34   | 10,68 | WBID O/N 20 proc. Bloomberg/EFFAS Bonds Indices, Poland Govt All > 1 Yr 80 proc.                                                                                                                                                                                    | 0,91 | 1,23  | 1,85  |
| Skarbiec TFI                           | Portfel funduszy – strategia płynnościowa                      | 1,38  | 6,10  | 0,21     | 9,67  | 1,42  | -1,81 | -7,80  | 4,67  | 50 proc. subfundusz Skarbiec Konserwatywny + 50 proc. subfundusz Skarbiec Krótkoterminowy. Do końca 2022 r. obowiązywał benchmark: mediana stopy zwrotu funduszy dłużnych polskich papierów skarbowych zgodnie z klasyfikacją funduszy nadaną przez Anality Online. | 5,89 | 8,25  | 5,99  |
| Dom Maklerski BOŚ                      | Portfel IKE/IKZE Ochrona                                       | 1,06  | 5,87  | 0,69     | 7,96  | 0,88  | -2,17 | -13,19 | 8,46  | WBID 6M                                                                                                                                                                                                                                                             | 5,18 | 7,08  | 11,02 |
| Caspar Asset Management                | Specjalistyczna Strategia Polskich Obligacji Skarbowych 02     | 3,28  | 6,30  | 1,30     | 7,92  | 1,21  | b.d.  | b.d.   | b.d.  | Stopa referencyjna NBP                                                                                                                                                                                                                                              | 5    | 6,71  | b.d.  |
| mBank Asset Management                 | Ochrony Kapitału                                               | -0,37 | 3,81  | -2,68    | 6,70  | -2,84 | -2,36 | 1,70   | 5,48  | 20 proc. BB Glob Aggr + 70 proc. BB Pol Govt + 10 proc. POLONIA – 0,8 proc. p.a.                                                                                                                                                                                    | 6,49 | 9,54  | -4,06 |
| Michael/Ström Dom Maklerski            | Strategia Dłużna                                               | -1,22 | 2,35  | 12813,88 | b.d.  | b.d.  | b.d.  | b.d.   | b.d.  | 100 proc. średnia funduszy papierów dłużnych globalnych uniwersalnych                                                                                                                                                                                               | 2,12 | b.d.  | b.d.  |
| Michael/Ström Dom Maklerski            | Strategia Konserwatywna                                        | 2,02  | 7,07  | 45106,58 | b.d.  | b.d.  | b.d.  | b.d.   | b.d.  | 100 proc. średnia funduszy papierów dłużnych polskich skarbowych                                                                                                                                                                                                    | 7,42 | b.d.  | b.d.  |

Zachęcamy do lektury całego artykułu: [Asset management. Polską giełdę czeka kolejny dobry rok - parkiet.com](#)

- [Drukuj](#)
- [PDF](#)
- 89 odsłon

[Wszystkie wiadomości](#)