Fundusze QUERCUS w gronie najlepszych produktów absolutnej stopy zwrotu

Analizy.pl dokonały kolejnego podsumowania wyników funduszy absolutnej stopy zwrotu na koniec września br.

Miło nam jest przekazać, że **w gronie najlepszych funduszy otwartych znalazły się QUERCUS Global Balanced** (100% skuteczność) i **QUERCUS Stabilny** (92% skuteczność).

Wielu funduszom wciąż daleko do ideału

Skuteczność funduszy absolutnej stopy zwrotu (fundusze otwarte) — dane na 30.09.2021

fundusze	liczba możliwych rolowanych 12-mies. stóp zwrotu w ost. 3 latach	liczba dodatnich 12-mies. stóp zwrotu (ich udział proc.)		3-letnia stopa zwrotu	czy wyższa od depozytów*	Ryzyko w skali 1-7 (SRRI)	data uruchomienia funduszu
Santander Prestiż Alfa	24	24	100%	21,3%	tak	3	sty 18
UNIQA Globalnej Makroalokacji	24	24	100%	19,3%	tak	3	lis 17
Pekao Alternatywny - Absolutnej Stopy Zwrotu	24	24	100%	10,8%	tak	3	cze 15
Energia Ochrony Absolutnej Stopy Zwrotu	24	24	100%	8,5%	tak	2	gru 17
QUERCUS Global Balanced	22	22	100%	-	-	4	gru 18
NN Globalnej Dywersyfikacji	4	4	100%	-	-	5	cze 20
Millennium Multistrategia	24	23	96%	40,5%	tak	4	lip 12
PZU Aktywny Akcji Globalnych	24	23	96%	13,2%	tak	4	maj 18
BNP Paribas Obligacji Wysokodochodowych	24	23	96%	10,1%	tak	4	lip 14
QUERCUS Stabilny	24	22	92%	25,1%	tak	4	paź 13
Superfund Silver Powiązany SFIO kat. Standardowa	24	22	92%	7,3%	tak	7	paź 06
Energia Agresywny Absolutnej Stopy Zwrotu	24	21	88%	16,9%	tak	5	gru 17
Aviva Globalnych Strategii	24	21	88%	5,4%	tak	4	lis 15
mBank Multiasset	14	12	86%	-	-	5	sie 19
Superfund GREEN	24	19	79%	14,7%	tak	6	gru 05
Skarbiec Market Opportunities	24	18	75%	5,9%	tak	5	lut 14
Superfund Alternatywny	24	18	75%	-0,5%	nie	5	gru 13
Opera Alfa-plus.pl	24	13	54%	18,0%	tak	4	kwi 09
NN (L) Multi Factor	24	13	54%	4,4%	tak	5	mar 16
MetLife Multistrategia	24	12	50%	4,1%	tak	4	sty 18
Skarbiec Market Neutral	24	9	38%	-6,0%	nie	4	sie 12
Superfund RED	24	4	17%	-25,7%	nie	5	gru 05
ALTIUS Absolutnej Stopy Zwrotu Dłużny	24	0	0%	-20,7%	nie	3	wrz 12

* subindeks oparty na rentowności mies. lokat międzybankowych (WIBID 1M)

Źródło: analizy.pl

*** fundusz działa krócej niż 3 lata, stopa zwrotu od początku działalności*

W gronie funduszy zamkniętych na prowadzeniu QUERCUS Multistrategy FIZ (skuteczność 96%).

Wciąż żaden z FIZ-ów absolute return nie ma 100% skuteczności

Skuteczność funduszy absolutnej stopy zwrotu (FIZ-y) dane na 30.09.2021

fundusze wyceniane min. raz w miesiącu	liczba możliwych rolowanych 12-mies. stóp zwrotu w ost. 36	liczba dodatnich 12-mies. stóp zwrotu		3-letnia stopa zwrotu	czy wyższa od depozytów*	data uruchomienia funduszu
QUERCUS Multistrategy FIZ	24	23	96%	66,9%	tak	gru 15
Eques Aktywnego Inwestowania FIZ	24	23	96%	34,6%	tak	sie 14
Ipopema Global Profit Absolute Return Plus FIZ	24	23	96%	28,4%	tak	gru 17
PZU FIZ Akord	24	20	83%	6,8%	tak	cze 15
Rockbridge FIZ Multi Inwestycja	24	15	63%	1,5%	nie	maj 11
Investor FIZ	24	15	63%	0,4%	nie	wrz 05
Lumen Polskie Perły FIZ	24	9	38%	-42,6%	nie	maj 14
Opera Za 3 Grosze FIZ	24	7	29%	-36,1%	nie	maj 07
fundusze wyceniane kwartalnie						
PKO Globalnej Strategii FIZ	8	1	13%	-6,0%	nie	sie 13
PKO Strategii Obligacyjnych FIZ	8	6	75%	1,4%	nie	mar 14
PKO Absolutnej Stopy Zwrotu Europa Wschód-Zachć	8	5	63%	-2,0%	nie	sie 16

* subindeks oparty na rentowności mies. lokat międzybankowych (WIBID 1M)

Źródło: analizy.pl

Cały artykuł dostępny jest pod linkiem: Skuteczność funduszy absolutnej stopy zwrotu (wrzesień 2021) – wciąż jest wiele do poprawy - Analizy.pl

- Drukuj
- PDF
- 10 odsłon

Wszystkie wiadomości