Fundusze absolutnej stopy zwrotu QUERCUS docenione przez Analizy.pl

Analizy.pl przygotowały tradycyjne podsumowanie skuteczności funduszy absolutnej stopy zwrotu.
Miło nam zakomunikować, że wśród funduszy otwartych **liderem okazał się QUERCUS Global Balanced**. Fundusz osiągnął 100% skuteczność, przy 3-letniej stopie zwrotu na poziomie +24,3%.
Bardzo dobrze zaprezentował się także QUERCUS Stabilny. Fundusz osiągnął 92% skuteczność, przy 3-letniej stopie zwrotu na poziomie +24,2%.

Co czwarty fundusz ma 100% skuteczności

Skuteczność funduszy absolutnej stopy zwrotu (fundusze otwarte) — dane na 31.12.2021

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
QUERCUS Global Balanced	24	24	100%	24,3%	tak	4	gru 18
Santander Prestiż Alfa	24	24	100%	20,0%	tak	3	sty 18
Pekao Alternatywny - Absolutnej Stopy Zwrotu	24	24	100%	13,2%	tak	3	cze 15
NN Globalnej Dywersyfikacji	7	7	100%	-	-	5	cze 20
Baltic Makro Alokacji	5	5	100%	-	-	4	sie 20
Ipopema Aktywnej Selekcji	3	3	100%	-	-	4	paź 20
Millennium Multistrategia	24	23	96%	50,4%	tak	4	lip 12
PZU Aktywny Akcji Globalnych	24	23	96%	14,5%	tak	4	maj 18
QUERCUS Stabilny	24	22	92%	24,2%	tak	4	paź 13
Energia Ochrony Absolutnej Stopy Zwrotu	24	22	92%	4,4%	tak	3	gru 17
mBank Multiasset	17	15	88%	-	-	4	sie 19
Superfund Silver Powiązany SFIO kat. Standardowa	24	21	88%	25,6%	tak	7	paź 06
Energia Agresywny Absolutnej Stopy Zwrotu	24	21	88%	16,3%	tak	5	gru 17
UNIQA Globalnej Makroalokacji	24	21	88%	16,0%	tak	4	lis 17
BNP Paribas Obligacji Wysokodochodowych	24	21	88%	15,0%	tak	4	lip 14
Aviva Globalnych Strategii	24	20	83%	13,2%	tak	4	lis 15
Superfund GREEN	24	19	79%	27,1%	tak	5	gru 05
Skarbiec Market Opportunities	24	16	67%	2,1%	nie	5	lut 14
Superfund Alternatywny	19	12	63%	-	-	6	cze 19
NN (L) Multi Factor	24	13	54%	7,1%	tak	5	mar 16
Opera Alfa-plus.pl	24	13	54%	6,6%	tak	5	kwi 09
MetLife Multistrategia	24	12	50%	6,3%	tak	4	sty 18
Superfund Silver	5	2	40%	-	-	7	sie 20
Skarbiec Market Neutral	24	9	38%	-6,7%	nie	4	sie 12
Superfund RED	24	1	4%	-27,7%	nie	5	gru 05
ALTIUS Absolutnej Stopy Zwrotu Dłużny	24	0	0%	-21,6%	nie	4	wrz 12

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

Źródło: analizy.pl

Wśród funduszy zamkniętych na drugiej pozycji pod względem skuteczności (96%) i na pierwszej pod względem 3-letniej stopy zwrotu (+58,7%) uplasował się

QUERCUS Multistrategy FIZ.

Tylko jeden FIZ absolute return ma 100% skuteczności

Skuteczność funduszy absolutnej stopy zwrotu (FIZ-y) — dane na 31.12.2021

fundusze wyceniane min. raz w miesiącu	liczba możliwych rolowanych 12-mies. stóp	liczba dodatnich 12-mies. stóp zwrotu		3-letnia stopa zwrotu	czy wyższa od depozytów*	data uruchomienia funduszu
Eques Aktywnego Inwestowania FIZ	24	24	100%	39,3%	tak	sie 14
QUERCUS Multistrategy FIZ	24	23	96%	58,7%	tak	gru 15
Ipopema Global Profit Absolute Return Plus FIZ	24	23	96%	25,6%	tak	gru 17
Rockbridge FIZ Multi Inwestycja	24	18	75%	12,3%	tak	maj 11
PZU FIZ Akord	24	17	71%	4,5%	tak	cze 15
Investor FIZ	24	15	63%	7,0%	tak	wrz 05
Lumen Polskie Perły FIZ	24	11	46%	-41,8%	nie	maj 14
Opera Za 3 Grosze FIZ	24	8	33%	-33,9%	nie	maj 07
fundusze wyceniane kwartalnie						
PKO Strategii Obligacyjnych FIZ	8	6	75%	2,4%	tak	mar 14
PKO Absolutnej Stopy Zwrotu Europa Wschód-Z	8	4	50%	-2,0%	nie	sie 16
PKO Globalnej Strategii FIZ	8	1	13%	-14,9%	nie	sie 13

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

Źródło: analizy.pl

Zachęcamy do lektury całego artykułu:
Skuteczność funduszy absolutnej stopy zwrotu (grudzień 2021) – tylko połowa na plusie - Analizy.pl

- Drukuj
- PDF
- 43 odsłony

Wszystkie wiadomości