

# NAVIGATOR



## Porównanie funduszy

## Porównanie Funduszy

**Porównanie funduszy** to narzędzie umożliwiające praktyczne porównanie dowolnych Otwartych Funduszy Emerytalnych między sobą według następujących kryteriów:

- wskaźnik Information Ratio z 12 miesięcy (IR 12M)
- wskaźnik Information Ratio z 36 miesięcy (IR 36M)
- wskaźnik Sharpe'a z 12 miesięcy (Sharp 12M)
- wskaźnik Sharpe'a z 36 miesięcy (Sharp 36M)
- odchylenie standardowe z 12 miesięcy (Ryzyko 12M)
- odchylenie standardowe z 36 miesięcy (Ryzyko 36M)
- Wartość Aktywów Netto funduszu (WAN)
- Liczba członków
- Pozycja w rankingu 12 miesięcznym (Rank 12M)
- Pozycja w rankingu 36 miesięcznym (Rank 36M)
- Stopy zwrotu z 12 miesięcy (12M)
- Stopy zwrotu z 36 miesięcy (36M)
- Stopy zwrotu z 60 miesięcy (60M)
- Annualizowana stopa zwrotu z 60 miesięcy (60M p.a.)

### Korzystanie z narzędzia Porównanie funduszy

**Krok 1:** Aby skorzystać z narzędzia należy w Menu Głównym wybrać zakładkę Nowy Raport a następnie ikonę „Porównanie funduszy”.



**Krok 2:** Po wykonaniu tej czynności otworzy się okno tego narzędzia. Należy tutaj wybrać porównywane fundusze, kryteria według których będą one porównywane oraz datę tego porównania.

Zrzutek ekranu okna narzędzia „Porównanie funduszy”. Okno ma tytuł „Porównanie funduszy” i zawiera sekcję „Parametry” z następującymi elementami: „Wybierz typ funduszy: emerytalne”, „Zarządzane przez: AEGON PTE, AIG PTE, AXA ...”, „Z segmentu: --- wybierz ---”, „Z grupy: --- wybierz ---”, „Dodaj do zestawienia: --- wybierz ---”. Po prawej stronie sekcji parametry znajduje się przycisk „Zatwierdź”. Poniżej sekcji parametry znajdują się dwa puste tablice z nagłówkami: „Nazwa funduszu”, „Kod firmy zarząd.”, „Typ”, „Kod grupy”, „Start”. W dolnej części okna znajdują się przyciski: „Dodaj”, „Dodaj wszystkie”, „Wybierz fundusz: ---”, „Kryteria porównania: ---”, „Data porównania: ---”, „Porównaj”, „Usuń”, „Usuń wszystkie”.

**Krok 3:** Aby porównać interesujące nas fundusze należy wybrać z okien wyboru fundusze emerytalne. Najszybszym sposobem jest „kliknięcie” na ikonie „Wybierz”. Spowoduje to automatyczne umieszczenie wszystkich Otwartych Funduszy Emerytalnych w obszarze z którego ostatecznie wybieramy porównywane fundusze.

**Krok 4:** W oknie widocznym na obrazku poniżej wybieramy fundusze, które będą wykorzystane w tworzonym porównaniu.

Nazwa funduszu	Kod grupy	Start
> AEGON OFE	EMP	1999-05-20
AIG OFE	EMP	1999-05-20
AXA OFE	EMP	1999-05-20
Allianz Polska OFE	EMP	1999-08-11
Bankowy OFE	EMP	1999-05-20
Commercial Union OFE	EMP	1999-05-20
Generali OFE	EMP	1999-05-20

Buttons: Dodaj, Dodaj wszystkie, Wybierz fundusz: [dropdown], Kryteria porównania: [dropdown], Data porównania: [dropdown], Porównaj

Do porównania można dodać wszystkie fundusze na raz bądź pojedynczo jeżeli porównywane będą tylko niektóre.

**Krok 5:** Następnie należy wybrać fundusz do którego reszta wcześniej wybranych instrumentów będzie porównywana.

**Krok 6:** Kolejną czynnością jest wybór kryteriów według których porównywane będą fundusze. Automatycznie wybierane są wszystkie kryteria. Możliwe jest dokonywanie porównań przy wykorzystaniu ich mniejszej liczby. Aby zmniejszyć liczbę kryteriów należy w oknie „Kryteria porównania” odznaczyć te które nie będą wykorzystywane.

**Krok 7:** Następnie wystarczy już tylko wybrać datę porównania oraz nacisnąć kursorem myszy na ikonie „Porównaj”.

**Krok 8:** Po wykonaniu powyższych czynności otworzy się okno Porównania.

Fundusz	IR 12M	IR 36M	Sharp 12M	Sharp 36M	Ryzyko 12M	Ryzyko 36M	WAN	Liczba członków	Rank 12M	Rank 36M	12M	36M	60M	60M p.a.
> AEGON OFE	+	+	+	+	-	+	+	+	+	+	+	+	+	+
AIG OFE	+	+	+	+	-	+	-	-	+	+	+	+	+	+
AXA OFE	-	+	+	+	-	+	-	+	+	+	+	+	+	+
Allianz Polska OFE	+	+	+	+	-	-	+	+	+	+	+	+	+	+
Bankowy OFE	+	+	+	+	+	+	+	+	+	+	+	+	+	+
Commercial Union OFE	+	+	+	+	+	+	-	-	+	+	+	+	+	+
ING OFE	+	+	+	+	+	+	+	+	+	+	+	+	+	+
Nordea OFE	+	+	+	+	+	+	+	-	+	+	+	+	+	+
OFE PZU "Złota Jesień"	+	+	+	+	+	+	-	-	+	+	+	+	+	+
OFE Pocztynion	+	+	+	+	-	+	+	+	+	+	+	+	+	+
OFE Polska	+	+	+	-	-	+	+	+	+	+	+	-	+	+
OFE Skarbiec - Emerytura	+	+	+	-	-	+	+	+	+	+	+	+	+	+
OFE WARTA	+	+	+	+	+	+	+	+	+	+	+	+	+	+
Pełkoo OFE	+	+	+	-	+	+	+	+	+	+	+	-	-	-

Legend:  neutralne,  konkurent lepszy,  Generali OFE lepszy

W oknie tym możemy modyfikować następujące elementy porównania:

- Porównywany fundusz
- Kryteria porównania
- Datę porównania