

Rood op de borden



Research en opleidingsinstituut BBOC houdt bij hoe de modelportefeuilles/profielfondsen volgens vijf verschillende profielen van verschillende aanbieders presteren. In deze IEX Profs de netto resultaten tot en met december van alle defensieve portefeuilles, de beste drie uit de overige categorieën en de index. De aanbieders zijn gerangschikt op het gemiddeld driejaarsrendement.

TOP-3 ZEER DEFENSIEF

Portefeuille	Profiel	Ytd	1 Jaar	3 Jaar ¹	Standaarddeviatie ²	Sharpe ²
ABN Amro Model Fund 1	Zeet Defensief	6,11%	6,11%	2,50%	2,40%	-0,59
Robeco Safe Mix	Zeet Defensief	0,56%	0,56%	1,20%	2,22%	-1,23
Allianz Zeet Defensief	Zeet Defensief	-0,87%	-0,87%	0,58%	2,72%	-1,25
Zeet Defensieve Index (10/90)	Zeet Defensief	1,00%	1,00%	0,89%	3,31%	-0,93

DEFENSIEF

Portefeuille	Profiel	Ytd	1 Jaar	3 Jaar ¹	Standaarddeviatie ²	Sharpe ²
SNS Optimaal Geel	Defensief	-5,76%	-5,76%	-1,15%	3,07%	-1,66
Allianz Defensief	Defensief	-8,50%	-8,50%	-1,68%	4,46%	-1,26
Petercam Balanced Low Risk	Defensief	-19,11%	-19,11%	-2,35%	7,62%	-0,82
Robeco Solid Mix	Defensief	-11,04%	-11,04%	-2,70%	5,01%	-1,32
Zwitserleven Defensief	Defensief	-17,18%	-17,18%	-3,41%	6,33%	-1,35
ING Dynamic Mix II	Defensief	-12,80%	-12,80%	-3,85%	4,88%	-1,57
ABN Amro Model Fund 3	Defensief	-13,54%	-13,54%	-4,48%	5,59%	-1,48
Fortis Stability	Defensief	-17,60%	-17,60%	-4,60%	7,28%	-1,35
AXA Model Fund II	Defensief	-19,61%	-19,61%	-5,92%	6,73%	-1,42
Insinger Defensief Gemengd	Defensief	-20,09%	-20,09%	-6,13%	6,81%	-1,43
NNEK Waakzaamheid	Defensief	-24,78%	-24,78%	-9,04%	9,19%	-1,33
Defensieve Index (30/70)	Defensief	-8,72%	-8,72%	-2,06%	4,36%	-1,38

TOP-3 NEUTRAAL

Portefeuille	Profiel	Ytd	1 Jaar	3 Jaar ¹	Standaarddeviatie ²	Sharpe ²
Paerel Alternative Fund	Neutraal	-26,35%	-26,35%	-4,18%	9,51%	-0,84
SNS Optimaal Oranje	Neutraal	-17,04%	-17,04%	-4,92%	6,32%	-1,37
Allianz Neutraal	Neutraal	-21,27%	-21,27%	-5,36%	8,19%	-1,11
Neutrale Index (50/50)	Neutraal	-17,71%	-17,71%	-5,04%	6,92%	-1,27

TOP-3 OFFENSIEF

Portefeuille	Profiel	Ytd	1 Jaar	3 Jaar ¹	Standaarddeviatie ²	Sharpe ²
Allianz Offensief	Offensief	-33,05%	-33,05%	-8,98%	12,47%	-0,98
ING Dynamic Mix IV	Offensief	-29,45%	-29,45%	-9,59%	10,73%	-1,18
Zwitserleven Ambitueus	Offensief	-36,66%	-36,66%	-9,66%	13,16%	-0,97
Offensieve Index (70/30)	Offensief	-26,01%	-26,01%	-8,03%	9,88%	-1,15

TOP-3 ZEER OFFENSIEF

Portefeuille	Profiel	Ytd	1 Jaar	3 Jaar ¹	Standaarddeviatie ²	Sharpe ²
Allianz Zeet Offensief	Zeet Offensief	-40,12%	-40,12%	-11,23%	15,67%	-0,89
Zwitserleven Offensief	Zeet Offensief	-41,68%	-41,68%	-11,66%	15,28%	-0,94
ING Dynamic Mix V	Zeet Offensief	-36,71%	-36,71%	-12,39%	13,86%	-1,07
Zeet Offensieve Index (90/10)	Zeet Offensief	-33,66%	-33,66%	-11,02%	12,97%	-1,07

1. Gemiddeld rendement per jaar; 2. Berekend over de laatste drie jaar.

De index bestaat uit de MSCI World Index en de JP Morgan European Government Bond Index.

De standaarddeviatie van de NNEK portefeuille is gebaseerd op kwartaalrendementen in plaats van op maandrendementen.