

SUPERFUND
Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A.

Ul. Dzielna 60, 01 029 Warszawa
Infolinia: 0 801 588 188
Tel.: 22 556 88 60, Fax.: 22 556 88 80

superfundtfi@superfund.com
www.superfund.pl

Warszawa, dnia 27 kwietnia 2018 r.

Informacje wymagane na podstawie art. 222b ustawy z dnia 27 maja 2004 r. o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi Dz. U. z 2014 poz. 157 z późn. zm) (dalej „Ustawa”) dla funduszy/subfunduszy zarządzanych przez Superfund Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A.

1. Udział procentowym aktywów, które są przedmiotem specjalnych ustaleń w związku z ich nie płynnością;

Na dzień publikacji niniejszej informacji brak takich aktywów w przypadku funduszy/subfunduszy zarządzanych przez Towarzystwo.

2. Zmiany regulacji wewnętrznych dotyczących zarządzania płynnością;

Do dnia publikacji niniejszej informacji nie miały miejsca zmiany regulacji wewnętrznych dotyczących zarządzania płynnością funduszy/subfunduszy zarządzanych przez Towarzystwo.

3. Aktualny profil ryzyka oraz informacja o systemie zarządzania ryzykiem stosowanym przez Towarzystwo;

Informacje o aktualnych profilach ryzyka funduszy/subfunduszy zarządzanych przez Towarzystwo wskazane są w dokumentach „Kluczowych informacji dla inwestorów” dotyczących poszczególnych funduszy/subfunduszy.

System, jaki stosowany jest przez Towarzystwo do zarządzania ryzykiem m. in. funduszy/subfunduszy zarządzanych przez Towarzystwo, ustanowiony został w procedurze „Regulamin Systemu Kontroli Wewnętrznej Superfund TFI S.A.” jako „System Zarządzania Ryzykiem”. System Zarządzania Ryzykiem, to wyodrębniony w ramach ogólnego Systemu Kontroli Wewnętrznej Towarzystwa system mający na celu ustanowienie, wdrożenie oraz zapewnienie stosowania Polityki Zarządzania Ryzykiem, obejmującej w szczególności procedury oceny narażenia każdego zarządzanego przez Towarzystwo Funduszu na poszczególne rodzaje ryzyka wchodzące w skład ryzyka

całkowitego, które mogą być istotne dla danego Funduszu. System Zarządzania Ryzykiem służy także zapewnieniu identyfikacji, monitorowania, pomiaru ryzyka, a także minimalizacji skutków niekorzystnych zdarzeń, na które narażone jest Towarzystwo. Do wykonywania zadań z zakresu Systemu Zarządzania Ryzykiem powołana została Komórka Zarządzania Ryzykiem, wyodrębniona w strukturze organizacyjnej Towarzystwa i niezależna jednostka organizacyjna.

4. Zmiany maksymalnego poziomu dźwigni finansowej AFI oraz informacja o prawie do ponownego wykorzystania zabezpieczeń lub gwarancji udzielonej na podstawie porozumienia dotyczącego dźwigni finansowej AFI;

Maksymalny poziom dźwigni finansowej AFI odnośnie do poszczególnych funduszy/subfunduszy zarządzanych przez Towarzystwo został wskazany w dokumentach „Informacja dla klienta alternatywnego funduszu inwestycyjnego” dotyczących danego funduszu/subfunduszu.

Do dnia publikacji niniejszej informacji nie miały miejsca zmiany maksymalnego poziomu dźwigni finansowej AFI odnośnie poszczególnych funduszy/subfunduszy zarządzanych przez Towarzystwo.

5. Łączna wysokość zastosowanej dźwigni finansowej AFI.

Na dzień 31 grudnia 2017 roku łączna wysokość zastosowanej dźwigni finansowej AFI (liczona metodą brutto AFI) wynosiła, w przypadku:

- Subfunduszu Superfund Red – 190,3%
- Subfunduszu Superfund Green – 183,4%
- Subfunduszu Superfund Blue – 175,7%
- Subfunduszu Superfund Akcji – 113,9%
- Subfunduszu Superfund Gold Future – 184%
- Subfunduszu Superfund Płynnościowy – 113,6%

- Subfunduszu Superfund Pieniężny – 110,2%
- Subfunduszu Superfund Obligacyjny – 93,7%
- Subfunduszu Superfund Akcyjny – 106,5%
- Subfunduszu Superfund Alternatywny – 109,1%

- Superfund Trend Podstawowy SFIO – 183,4%