

Superfund Green - Raport z zarządzania 06/2013

STRATEGIA MANAGED FUTURES

Strategia managed futures - Superfund Green - opiera się na podążaniu za trendami, o czasie trwania od średnio- do długoterminowym. Spektrum możliwości transakcyjnych obejmuje około 150 rynków całego świata, zarówno finansowych, jak i surowcowych. W celu jak najlepszego wykorzystania tak szerokiej dywersyfikacji, strategię Superfund Green wzbogacają również krótkoterminowe strategie, takie jak modele prognostyczne czy inwestowanie pod odwrócenie trendu. Taka kompozycja strategii pozwala na osiągnięcie zysków na wzrostach, jak również na spadkach instrumentów rynkowych. Od marca 1996 roku fundusze Superfund Green działają na świecie, bazując na autorskim, w pełni zautomatyzowanym systemie transakcyjnym, pozbawionym emocji towarzyszących człowiekowi. Ryzyko jest nieustannie monitorowane, a wielkość każdej pozycji jest dostosowywana do zmienności rynku, na którym transakcja jest zawierana. Dzięki niskiej korelacji z tradycyjnymi klasami aktywów w długim terminie, fundusze typu managed futures - Superfund Green - w Polsce reprezentowane przez Superfund SFIO B, C oraz TREND Plus i TREND Bis - są doskonałym wzbogaceniem każdego portfela inwestycyjnego.

Analiza stopy zwrotu

SUPERFUND GREEN A - TRADYCYJNA

SUPERFUND GREEN Q-AG¹

Data uruchomienia	08.03.1996
Wartość początkowa	1.000,00
Od uruchomienia	503,63 %
Średniorocznie	10,94 %
% miesięcy pozytywnych	55,29 %
Max. obsunięcie kapitału	37,41 %
Depozyt zabezpieczający	11,87

2013

Sty	4,33 %
Lut	0,78 %
Mar	1,47 %
Kwi	11,70 %
Maj	-8,26 %
Cze	-3,21 %*
Lip	
Sie	
Wrz	
Paz	
Lis	
Grudz	

SINCE START

1996	-10,30 %	2008	35,44 %
1997	20,70 %	2009	-24,46 %
1998	62,55 %	2010	12,93 %
1999	25,39 %	2011	-17,35 %
2000	23,19 %	2012	-7,70 %
2001	18,82 %	2013	5,82 %
2002	38,42 %		
2003	24,33 %		
2004	10,98 %		
2005	-3,30 %		
2006	10,47 %		
2007	-1,81 %		

Wskaźnik Sharp'a² 0,46

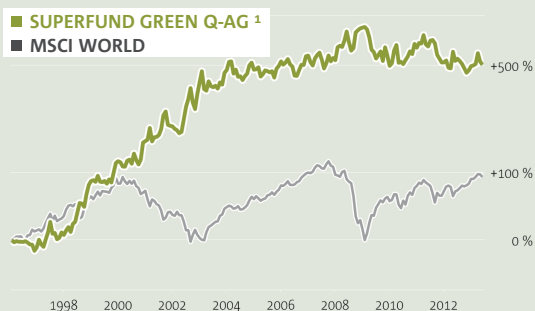
Wskaźnik MAR 0,29

Korelacja z indeksem S&P500 -0,11

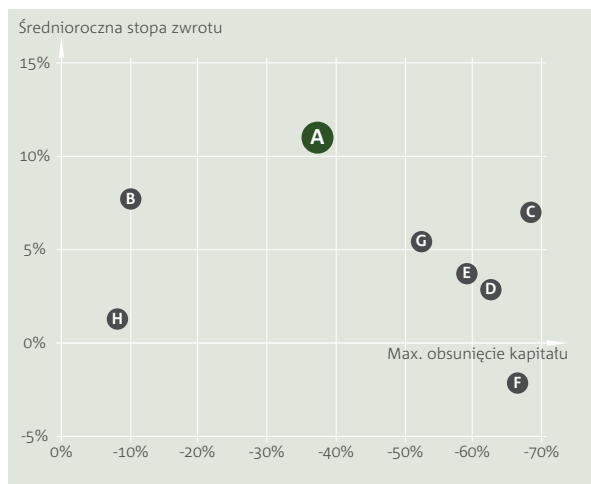
MSCI World 91,18 %

5,82 %

Total: 503,63 %



RELACJA ZYSK/RYZYKO



Źródło: Teletrader, Okres: 03/1996-06/2013, A) Superfund Green Q-AG¹, B) CISDM CTA Equal Weighted Index (03/1996-05/2013), C) DAX, D) Euro Stoxx 50, E) Hang Seng, F) Nikkei 225, G) S&P 500, H) REX

ANALIZA KORELACJI

	A	B	C	D	E	F	G
A) Superfund Green	1,00						
B) CTA Index	0,73	1,00					
C) DAX	-0,11	-0,11	1,00				
D) Euro Stoxx 50	-0,09	-0,10	0,94	1,00			
E) Hang Seng	-0,04	0,04	0,58	0,60	1,00		
F) Nikkei 225	-0,04	-0,08	0,53	0,56	0,50	1,00	
G) S&P 500	-0,11	-0,08	0,79	0,82	0,66	0,59	1,00

Źródło: Teletrader, Okres: 03/1996-06/2013, A) Superfund Green Q-AG¹, B) CISDM CTA Equal Weighted Index (03/1996-05/2013)

* Szacunkowe dane indeksu na koniec miesiąca
1) fundusz niedostępny dla nowych inwestorów
2) modyfikowany (stopa wolna od ryzyka = 0)

Superfund Green - Raport z zarządzania 06/2013

Wyniki na poszczególnych rynkach



Rynki	Alokacja	Wynik	Wpływ na wynik
Indeksy akcji	21 %	-1,94 %	
Obligacje	14 %	1,70 %	
Stopy procentowe	6 %	-0,47 %	
Waluty	14 %	-1,82 %	
Zboża	7 %	-0,48 %	
Surowce energetyczne	17 %	-3,87 %	
Metale	14 %	3,73 %	
Rynki rolne	7 %	-0,06 %	
Total	100 %	-3,21 %	

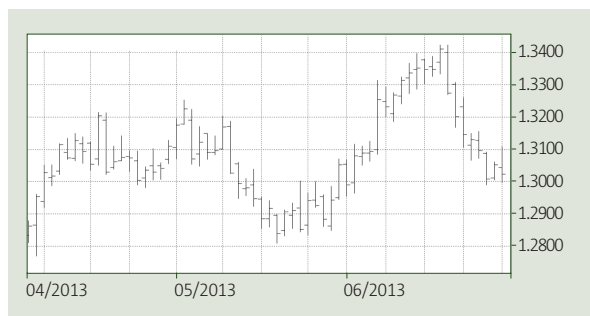
Analiza pozycji (Wpływ na miesięczny wynik)

Najlepsze wyniki	Pozycja	Wynik
COMEX_Gold	L/S	1,74 %
LME_Copper(3M)	Short	0,76 %
LME_Aluminum(3M)	L/S	0,73 %

Najgorsze wyniki	Pozycja	Wynik
NYMEX_Crude_Oil	L/S	-1,06 %
NYMEX_HeatingOil	L/S	-0,95 %
IPE_Brent_Cr_Oil	L/S	-0,81 %

Analiza rynku (Wpływ na miesięczny wynik)

CME_EUROCURRENCY L/S | -0,54 %



NYMEX_CRUDE_OIL L/S | -1,06 %



COMEX_GOLD L/S | 1,74 %



CBT_SOYBEAN_MEAL Long | 0,00 %



Tytuły uczestnictwa funduszu Superfund Q-AG nie są zbywane w Polsce. Przedstawiane informacje mają charakter poglądowy i mają umożliwić polskiemu odbiorcy bliższe zapoznanie się z efektami stosowania strategii inwestycyjnych opracowanych przez Superfund i stosowanych w produktach finansowych oferowanych na różnych rynkach finansowych na świecie. Szczegółowe informacje związane z uczestnictwem w funduszach inwestycyjnych zarządzanych przez Superfund TFI SA w Polsce, w tym w szczególności opis czynników ryzyka, zawarte zostały w prospektach informacyjnych funduszy publicznie dostępnych na stronie internetowej: www.superfund.pl. Towarzystwo zwraca uwagę, że dane finansowe dotyczące wyników inwestycyjnych funduszy mają charakter historyczny i nie stanowią gwarancji osiągnięcia podobnych w przyszłości. Pamiętajcie należy ponadto, iż fundusze nie gwarantują realizacji założonego celu inwestycyjnego, a uczestnik funduszu musi liczyć się z możliwością poniesienia strat w związku z dokonaną inwestycją w jednostki uczestnictwa. Osoba zainteresowana uczestnictwem w funduszu powinna być świadoma istnienia opłat manipulacyjnych związanych z nabywaniem oraz odkupywaniem jednostek uczestnictwa, jak również faktu, iż dochód osiągnięty w związku z uczestnictwem w funduszu podlega opodatkowaniu. Obowiązująca tabela opłat manipulacyjnych dostępna jest publicznie na stronie internetowej: www.superfund.pl. Wartość inwestycji oraz osiąganego z niej przychodu może ulegać znacznym wahaniom i nie jest w żaden sposób gwarantowana. Z uwagi na skład portfeli inwestycyjnych funduszy, wartość aktywów netto funduszy może charakteryzować się dużą zmiennością. Towarzystwo zachęca do zapoznania się ze szczegółowymi informacjami finansowymi oraz prawnymi, które zawarte zostały w prospektach informacyjnych funduszy.