Warszawa, dnia 26 kwietnia 2021 roku

List Superfund Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych S.A. do Uczestników Superfund Sharpe Parity Ucits, Subfunduszu wydzielonego w ramach Superfund Fundusz Inwestycyjny Otwarty Portfelowy

Szanowni Państwo,

Przedstawiamy Państwu informację Superfund Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych S.A., dotyczącą działalności Subfunduszu Superfund Sharpe Parity Ucits, wydzielonego w ramach Superfund Fundusz Inwestycyjny Otwarty Portfelowy, za okres od 1 stycznia 2020 roku do 31 grudnia 2020 roku, to jest za okres, za który sporządzone zostało roczne jednostkowe sprawozdanie finansowe Subfunduszu.

Superfund Fundusz Inwestycyjny Otwarty Portfelowy, w ramach którego wydzielony jest Subfundusz Superfund Sharpe Parity Ucits, jest funduszem inwestycyjnym z wydzielonymi subfunduszami, zarządzanymi według strategii inwestycyjnych, zróżnicowanych pod względem sposobu inwestowania, oczekiwanych zysków i poziomu ryzyka.

Celem inwestycyjnym Superfund Sharpe Parity Ucits jest stabilny, długoterminowy wzrost wartości jego aktywów w wyniku wzrostu wartości lokat, głównie poprzez inwestycje pośrednie na rynkach akcji i obligacji. Subfundusz dąży do realizacji celu inwestycyjnego przede wszystkim poprzez aktywną alokację pomiędzy dopuszczalnymi kategoriami lokat oraz odpowiedni dobór do portfela Subfunduszu funduszy zagranicznych, instytucji wspólnego inwestowania z siedzibą za granicą oraz funduszy inwestycyjnych otwartych. Co najmniej 50% wartości aktywów subfunduszu Superfund Sharpe Parity Ucits stanowią lokaty nabyte poza granicami Rzeczypospolitej Polskiej za walutę Euro lub denominowane w Euro.

W omawianym okresie sprawozdawczym zmiana wartości jednostki uczestnictwa wyniosła: **-0,55%.**

Strategia funduszu dąży do uzyskania dodatniej stopy zwrotu w każdych warunkach rynkowych. Fundusz przy wykorzystaniu instrumentów pochodnych może zajmować ekspozycje na wzrosty cen w okresie trwania hossy oraz na spadki cen, gdy koniunktura słabnie. Rok 2020 był szczególnym rokiem na rynkach finansowych z powodu trwania pandemii koronawirusa, która wywołała znaczne osłabienie koniunktury gospodarczej na świecie. Mimo, że subfundusz osiągnął zysk w czwartym kwartale, to nie był on wystarczająco wysoki aby pokryć stratę, która zrealizowała się w trzecim kwartale. Na takie ukształtowanie się wyników miało wpływ zwiększenie w drugim półroczu ekspozycji na metale szlachetne przez Subfundusz, co zbiegło się z korektą na tym rynku.

Z poważaniem,

Paweł Grubiak — Prezes Zarządu

Aneta Żółkowska — Członek Zarządu