

## STRATEGIA INWESTYCYJNA

Superfund GoldFuture jest unikalnym funduszem, który łączy ekspozycję na rynek złota ze strategią managed futures. Strategia managed futures inwestuje w szeroką gamę instrumentów finansowych - kontrakty terminowe, akcje, obligacje, towary i waluty. Proces podejmowania decyzji w strategii managed futures jest oparty na algorytmach co sprawia, że decyzje inwestycyjne nie podlegają wpływowi emocji.

## PODSTAWOWE INFORMACJE



Typ funduszu: **Rynku surowców - metale szlachetne**  
 Data uruchomienia: **2007-10-17**  
 Aktualna wartość j.u.: (2023-08-31): **421.04**  
 Horyzont inwestycyjny: **3 lata**  
 Min. pierwsza wpłata (os. prawne): **500 PLN**  
 Min. pierwsza wpłata (os. fizyczne): **równowartość 40 000 EUR**  
 Min. kolejna wpłata: **500 PLN**  
 Opłata za nabycie: **2,00 %**  
 Opłata za odkupienie: **0,00 %**  
 Opłata za zarządzanie: **2,00 %**  
 Waluta: **PLN, EUR, USD**  
 Rachunek nabycia PLN: **84 1880 0009 0000 0013 0053 9000**  
 Rachunek nabycia EUR: **30 1880 0009 0000 0013 0053 9002**  
 Rachunek nabycia USD: **73 1880 0009 0000 0013 0053 9004**

## PROFIL RYZYKA

1 2 3 4 5 6 7

## WYNIKI



Superfund GoldFuture kat. A PLN



Wykres notowań od: 2007-10-17 do: 2023-08-31.

## STATYSTYKA

Alpha: **-1,45 %**  
 Beta: **0,6900**  
 R<sup>2</sup>: **24,27 %**  
 Tracking Error: **17,68 %**  
 Odchylenie standardowe: **5,68 %**  
 Sharpe ratio: **-0,2993 (WIBID 1M)**  
 IR: **-0,9919**

Wskaźniki statystyczne liczone są na bazie miesięcznych stóp zwrotu, za okres do 3 lat, na dzień 2023-08-31.

	1M	3M	6M	12M	36M	60M	120M	YTD
Superfund GoldFuture kat. A PLN	-9,46 %	-12,65 %	-20,81 %	-28,73 %	-43,69 %	-14,76 %	-39,27 %	-24,45 %

	Sty	Lut	Mar	Kwi	Maj	Cze	Lip	Sie	Wrz	Paź	Lis	Gru	Sty-Gru
2018	9,9 %	-8,4 %	-0,8 %	-2,9 %	-1,9 %	-9,4 %	-1,8 %	-2,4 %	-6,0 %	-8,5 %	0,3 %	2,9 %	-26,6 %
2019	5,6 %	4,4 %	-0,3 %	2,9 %	-3,8 %	11,8 %	3,9 %	12,5 %	-7,0 %	-2,4 %	1,2 %	4,6 %	36,6 %
2020	8,1 %	2,3 %	0,7 %	7,2 %	-5,4 %	-0,7 %	11,3 %	0,2 %	-9,9 %	-5,3 %	-3,2 %	5,6 %	9,0 %
2021	0,4 %	4,6 %	-7,2 %	6,7 %	9,1 %	-8,9 %	6,5 %	-3,0 %	-5,7 %	7,8 %	-6,3 %	2,0 %	3,8 %
2022	-1,8 %	8,1 %	7,8 %	-0,3 %	-0,9 %	-10,3 %	-4,1 %	-10,2 %	-2,8 %	-4,3 %	0,7 %	0,7 %	-17,7 %
2023	-1,2 %	-3,5 %	-7,5 %	-0,9 %	-1,1 %	-4,0 %	0,5 %	-9,5 %					-24,5 %

Stopy zwrotu na dzień 2023-08-31.

## BEZPIECZNA PRZYSTAŃ

Inwestycja w złoto w niepewnych czasach traktowane jest jako "bezpieczna przystań"

## DIWERSYFIKACJA

Dodatkowo globalnie zdywersyfikowany portfel z ekspozycją na akcje, obligacje, waluty i surowce

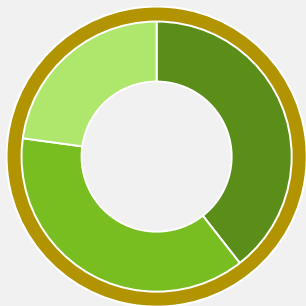
## ZŁOTO + MANAGED FUTURES

Superfund GoldFuture jest połączeniem inwestycji w złoto i strategii managed futures (Superfund Green)

## STRUKTURA AKTYWÓW

### INSTRUMENTY

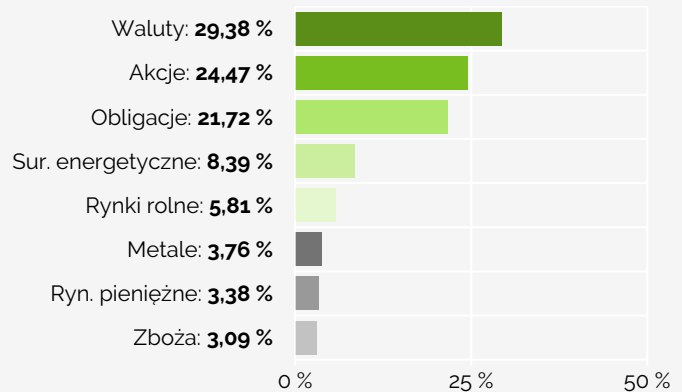
(2023-06-30 - funduszu bazowego)



- 100 % Złoto (futures)
- 39.44 % Fund. rynku pieniężnego
- 37.73 % Kontrakty terminowe
- 22.83 % Gotówka

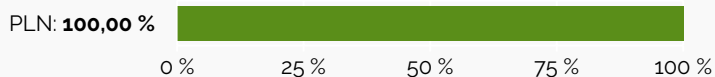
### KONTRAKTY TERMINOWE

(2023-06-30 - funduszu bazowego)



### WALUTY

(2023-06-30)



## WAŻNE INFORMACJE

Z inwestycją w Subfundusz mogą wiązać się następujące ryzyka: **Ryzyko rynkowe** związane jest z wahaniami cen instrumentów finansowych. Ryzyka tego nie można wyeliminować, a ma ono bezpośredni wpływ na wartość inwestycji uczestnika w Subfunduszu. **Ryzyko kontrahenta** związane jest z możliwością lokowania do 100% aktywów Subfunduszu w tytuły uczestnictwa funduszu zagranicznego Superfund Sicav. Ewentualne problemy funduszu zagranicznego będą miały bezpośredni wpływ na sytuację Subfunduszu. **Ryzyko płynności** związane jest przede wszystkim z potencjalnymi trudnościami ze zbyciem tytułów uczestnictwa funduszu zagranicznego Superfund Sicav, którego tytuły uczestnictwa stanowią podstawowy składnik aktywów Subfunduszu. W takim przypadku Subfundusz może nie być w stanie zrealizować terminowo zleceń uczestników. **Ryzyko rozliczenia** związane jest z możliwością nieterminowych rozliczeń zawartych transakcji, co może skutkować poniesieniem przez Subfundusz dodatkowych kosztów. **Ryzyko związane z przechowywaniem aktywów** wynika z faktu, iż aktywa Subfunduszu przechowywane są przez Depozytariusza oraz w części przez subdepozytariuszy. Ewentualne problemy lub błędy tych instytucji mogą mieć wpływ na możliwość dysponowania aktywami lub na ich wartość. Szczegółowe informacje związane z uczestnictwem w subfunduszach wydzielonych w ramach Superfund Specjalistycznego Funduszu Inwestycyjnego Otwartego, w tym w szczególności: polityka inwestycyjna, opis czynników ryzyka, zasady zbywania i odkupywania jednostek uczestnictwa, prawa uczestników, informacje o podmiotach prowadzących dystrybucję jednostek uczestnictwa, zawarte zostały w prospekcie informacyjnym funduszu, dostępnym w języku polskim na stronie internetowej Superfund Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. pod adresem: [https://superfund.pl/files/Superfund\\_SFIO\\_Prospekt.pdf](https://superfund.pl/files/Superfund_SFIO_Prospekt.pdf), jak również u dystrybutorów jednostek uczestnictwa oraz bezpośrednio w siedzibie Towarzystwa. Kluczowe informacje dla inwestorów są dostępne w języku polskim na stronie internetowej Towarzystwa pod adresem: [https://superfund.pl/files/20230329\\_Superfund\\_SFIO\\_GoldFuture\\_KID.pdf](https://superfund.pl/files/20230329_Superfund_SFIO_GoldFuture_KID.pdf). Roczne sprawozdanie finansowe subfunduszu dostępne jest w języku polskim na stronie internetowej Towarzystwa pod adresem: [https://superfund.pl/files/Superfund\\_SFIO\\_GoldFuture\\_Roczne\\_2022.pdf](https://superfund.pl/files/Superfund_SFIO_GoldFuture_Roczne_2022.pdf). Streszczenie praw Uczestników dostępne jest w języku polskim na stronie internetowej Towarzystwa pod adresem: <https://superfund.pl/informacjeprawne?doc=streszczenieprawuczestnikow>. Towarzystwo może podjąć decyzję o wycofaniu się z uzgodnień dotyczących wprowadzenia do obrotu przedsiębiorstw zbiorowego inwestowania zgodnie z art. 32a dyrektywy 2011/61/UE. Towarzystwo zwraca uwagę, że jakiegokolwiek dane finansowe przedstawione w niniejszej informacji nie stanowią gwarancji osiągnięcia podobnych w przyszłości. Historyczne dane dotyczące wypracowanych stóp zwrotu nie mogą stanowić podstawy do wyciągania wniosków, co do kształtowania się dynamiki ich wzrostu w przyszłości. Wartość inwestycji oraz osiąganego z niej przychodu może ulegać znacznym wahaniami i nie jest w żaden sposób gwarantowana. Towarzystwo zachęca do zapoznania się ze szczegółowymi informacjami finansowymi oraz prawnymi, które zawarte zostały w prospekcie informacyjnym funduszu.

