

## STRATEGIA INWESTYCYJNA

Superfund Green, charakteryzuje się niską korelacją z rynkami akcji i obligacji. Stosowana strategia czyni ten rodzaj produktów finansowych całkowicie odmiennym, a zarazem innowacyjnym na tle klasycznych form inwestowania i jest idealnym sposobem na dokonanie dywersyfikacji portfela inwestycyjnego. Strategia bazuje na zasadzie podążania za trendami, co oznacza, że system obserwuje ruchy cen na rynkach i czeka na okazje inwestycyjne, ażeby jak najlepiej wykorzystać potencjał występujących trendów – to sprawia, że potrafi wygenerować dodatnie stopy zwrotu niezależnie od tego czy rynek rośnie, czy spada. Strategia korzysta z własnych, w pełni zautomatyzowanych systemów transakcyjnych, inwestujących na około 150 międzynarodowych rynkach kontraktów terminowych zapewniających odpowiednią dywersyfikację oraz szybkie i pozbawione emocji reagowanie na sygnały rynkowe.

## PODSTAWOWE INFORMACJE



Typ funduszu: **Absolutnej stopy zwrotu**  
 Data uruchomienia: **2005-12-13**  
 Aktualna wartość j.u.: (2023-08-31): **551.77**  
 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: **1,20 %**  
 Waluta: **PLN, EUR, USD**  
 Rachunek nabycia PLN: **05 1880 0009 0000 0013 0047 3007**  
 Rachunek nabycia EUR: **36 1880 0009 0000 0013 0047 3031**  
 Rachunek nabycia USD: **58 1880 0009 0000 0013 0047 3023**

## PROFIL RYZYKA

1 2 3 4 5 6 7

## WYNIKI



Wykres notowań od: 2005-12-13 do: 2023-08-31.

## STATYSTYKA

Alpha: **-1,36 %**  
 Beta: **0,1154**  
 R<sup>2</sup>: **3,95 %**  
 Tracking Error: **28,16 %**  
 Odchylenie standardowe: **4,49 %**  
 Sharpe ratio: **-0,3495 (WIBID 1M)**  
 IR: **-0,8135**

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 Green kat. A PLN	-8,30 %	-11,16 %	-24,68 %	-34,54 %	-39,68 %	-34,72 %	-32,95 %	-27,35 %					
	Sty	Lut	Mar	Kwi	Maj	Cze	Lip	Sie	Wrz	Paź	Lis	Gru	Sty-Gru
2018	6,7 %	-9,1 %	-0,9 %	0,1 %	-2,7 %	-3,7 %	0,6 %	-0,4 %	-5,0 %	-11,4 %	0,7 %	-0,5 %	-23,8 %
2019	3,8 %	3,4 %	2,2 %	4,3 %	-4,0 %	3,0 %	2,9 %	5,3 %	-5,4 %	-1,2 %	3,5 %	1,3 %	20,0 %
2020	3,4 %	-0,6 %	3,8 %	2,0 %	-3,0 %	-3,3 %	5,7 %	-0,8 %	-6,9 %	-3,6 %	1,2 %	0,7 %	-2,1 %
2021	2,6 %	7,7 %	-2,0 %	2,3 %	1,7 %	-2,0 %	2,7 %	-1,8 %	-1,3 %	3,4 %	-5,7 %	0,9 %	8,3 %
2022	-0,9 %	3,0 %	5,0 %	1,9 %	0,8 %	-8,0 %	0,3 %	-8,4 %	1,0 %	-3,3 %	-5,5 %	-2,4 %	-16,2 %
2023	-5,9 %	2,5 %	-14,9 %	-1,0 %	0,6 %	-1,5 %	-1,7 %	-8,3 %					-27,4 %

Stopy zwrotu na dzień 2023-08-31.

## SYSTEM TRANSAKCYJNY

Inwestycja w oparciu o autorski system transakcyjny.

## ŚLEDZENIE TRENDÓW

Koncentracja na wykrywaniu jasno zdefiniowanych trendów inwestycyjnych.

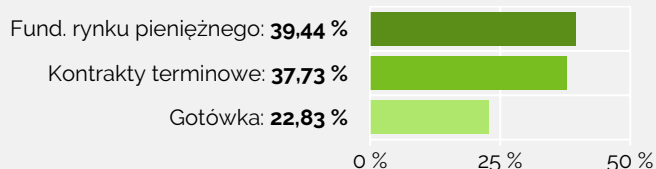
## DYWERSYFIKACJA

Zapewnienie niskiej korelacji pomiędzy aktywami, poprzez aktywne inwestycje na 150 globalnych rynkach.

## STRUKTURA AKTYWÓW

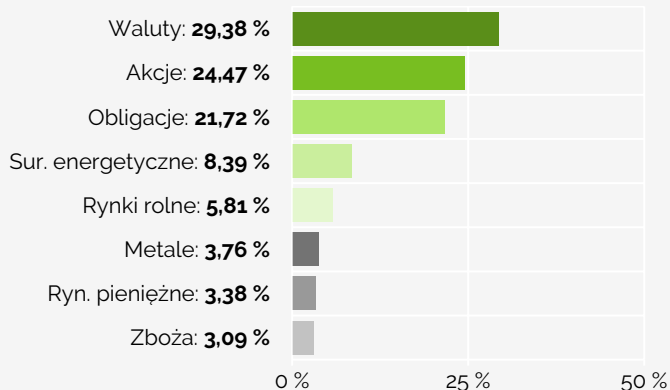
### INSTRUMENTY

(2023-06-30 - funduszu bazowego)



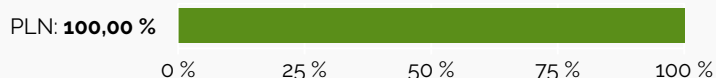
### KONTRAKTY TERMINOWE

(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 realizować 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\\_Green\\_KID.pdf](https://superfund.pl/files/20230329_Superfund_SFIO_Green_KID.pdf). Roczne sprawozdanie finansowe subfunduszu dostępne jest w języku polskim na stronie internetowej Towarzystwa pod adresem: [https://superfund.pl/files/Superfund\\_SFIO\\_Green\\_Roczne\\_2022.pdf](https://superfund.pl/files/Superfund_SFIO_Green_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 przedsięwzięcia 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.

