

STRATEGIA INWESTYCYJNA

Superfund Red, 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 krótkoterminowymi 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 60 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: **2013-05-06**
 Aktualna wartość j.u.: (2023-08-31): **292.89**
 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: **41 1880 0009 0000 0013 0047 1001**
 Rachunek nabycia EUR: **44 1880 0009 0000 0013 0047 1044**
 Rachunek nabycia USD: **66 1880 0009 0000 0013 0047 1036**

PROFIL RYZYKA

1 2 3 4 5 6 7

WYNIKI



Wykres notowań od: 2013-05-06 do: 2023-08-31.

STATYSTYKA

Alpha: **-1,63 %**
 Beta: **0,4627**
 R²: **34,02 %**
 Tracking Error: **19,93 %**
 Odchylenie standardowe: **5,44 %**
 Sharpe ratio: **-0,2651 (WIBID 1M)**
 IR: **-1,3102**

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 Red kat. A PLN	-5,21 %	-2,81 %	2,15 %	0,81 %	-37,83 %	-44,36 %	-61,95 %	-6,59 %

	Sty	Lut	Mar	Kwi	Maj	Cze	Lip	Sie	Wrz	Paź	Lis	Gru	Sty-Gru
2018	0,4 %	-10,6 %	0,6 %	0,5 %	-4,5 %	-1,9 %	1,2 %	1,8 %	-1,4 %	-4,6 %	1,2 %	4,3 %	-12,9 %
2019	1,2 %	3,6 %	1,7 %	2,9 %	-3,9 %	2,9 %	0,2 %	-4,4 %	-0,1 %	-3,7 %	1,8 %	3,3 %	5,0 %
2020	-0,9 %	-5,1 %	-5,7 %	-0,4 %	-2,6 %	1,2 %	1,6 %	-3,1 %	-4,7 %	-5,2 %	1,2 %	5,5 %	-17,2 %
2021	-0,7 %	0,2 %	-8,6 %	3,7 %	4,3 %	-6,1 %	3,6 %	-4,7 %	-7,0 %	4,6 %	-5,8 %	-0,5 %	-16,8 %
2022	-2,0 %	0,6 %	7,7 %	-8,2 %	-6,4 %	-7,4 %	2,3 %	-11,1 %	-7,1 %	0,9 %	7,7 %	6,9 %	-17,1 %
2023	0,9 %	-9,4 %	7,7 %	0,9 %	-3,3 %	-1,7 %	4,3 %	-5,2 %					-6,6 %

Stopy zwrotu na dzień 2023-08-31.

SYSTEM TRANSAKCYJNY

Inwestycja w oparciu o autorski system transakcyjny.

ŚLEDZENIE TRENDÓW

Koncentracja na wykrywaniu jasno zdefiniowanych krótkoterminowych trendów inwestycyjnych.

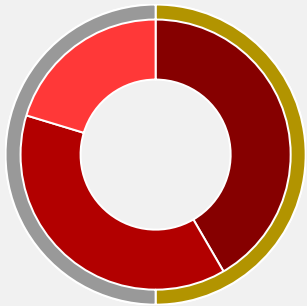
DYWERSYFIKACJA

Zapewnienie niskiej korelacji pomiędzy aktywami, poprzez aktywne inwestycje na 60 globalnych rynkach.

STRUKTURA AKTYWÓW

INSTRUMENTY

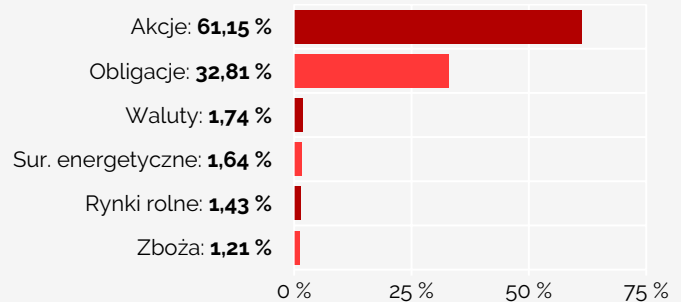
(2023-06-30 - funduszu bazowego)



- 33 % Kontrakty term. złoto
- 33 % Kontrakty term. srebro
- 41.61 % Fund. rynku pieniężnego
- 38.07 % Kontrakty terminowe
- 20.31 % 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, 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_Red_KID.pdf. Roczne sprawozdanie finansowe subfunduszu dostępne jest w języku polskim na stronie internetowej Towarzystwa pod adresem: https://superfund.pl/files/Superfund_SFIO_Red_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 wahanom 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.