

## STRATEGIA INWESTYCYJNA

Superfund Spokojna Inwestycja to fundusz z grupy funduszy dłużnych polskich uniwersalnych, który inwestuje przede wszystkim w instrumenty dłużne o czasie do wykupu nie przekraczającym jednego roku oraz obligacje o zmiennym kuponie. Dzięki temu osiąga niską zmienność wyniku i jest atrakcyjną opcją inwestycyjną dla osób poszukujących alternatywy dla niskoprocentowanych lokat bankowych. Subfundusz inwestuje zarówno bezpośrednio w instrumenty dłużne, jak i poprzez nabywanie jednostek uczestnictwa innych funduszy dłużnych. Konstrukcja ta pozwala na elastyczne przebudowywanie portfela pomiędzy segmentami obligacji skarbowych i korporacyjnych. Waluta bazowa funduszu to PLN. Zarządzający mogą dokonywać inwestycji zagranicznych i stosować zabezpieczenie ryzyka kursowego.

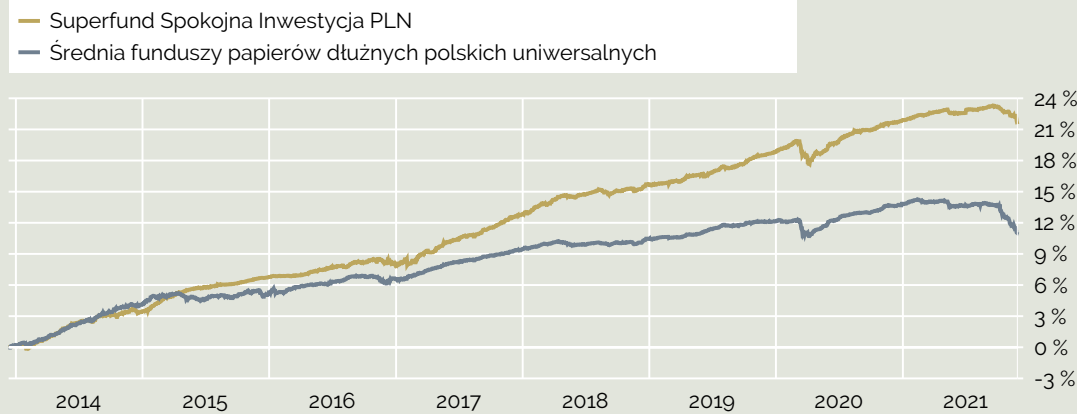
## PODSTAWOWE INFORMACJE

Typ funduszu: **papierów dłużnych polskich uniwersalnych**  
 Data uruchomienia: **2013-12-10**  
 Aktualna wartość j.u.: (2021-11-26): **121.65**  
 Horyzont inwestycyjny: **1 rok**  
 Min. pierwsza wpłata: **100 PLN**  
 Min. kolejna wpłata: **100 PLN**  
 Opłata za nabycie: **0,00 %**  
 Opłata za odkupienie: **0,00 %**  
 Opłata za zarządzanie: **0,70 %**  
 Waluta: **PLN**  
 Rachunek nabycia PLN: **65 1880 0009 0000 0013 0090 6002**

## PROFIL RYZYKA

1 2 3 4 5 6 7

## WYNIKI



## STATYSTYKA

Alpha: **0,13 %**  
 Beta: **0,8453**  
 R<sup>2</sup>: **72,32 %**  
 Tracking Error: **0,61 %**  
 Odchylenie std.: **0,32 %**  
 Sharpe ratio: **0,3577**  
 IR: **2,2936**

|   | 1M      | 3M      | 6M      | 12M     | 36M    | 60M     | MTD     | YTD     | MAX     |
|---|---------|---------|---------|---------|--------|---------|---------|---------|---------|
| Superfund Spokojna Inwestycja PLN                         | -0,95 % | -1,28 % | -0,84 % | -0,10 % | 5,51 % | 12,28 % | -0,99 % | -0,34 % | 21,50 % |
| Średnia funduszy papierów dłużnych polskich uniwersalnych | -1,20 % | -2,42 % | -2,20 % | -2,22 % | 1,04 % | 4,53 %  | -1,14 % | -2,37 % | 11,12 % |

|      | Sty   | Lut    | Mar    | Kwi   | Maj    | Cze   | Lip   | Sie    | Wrz   | Paź    | Lis    | Gru    | Sty-Gru |
|------|-------|--------|--------|-------|--------|-------|-------|--------|-------|--------|--------|--------|---------|
| 2016 | 0,1 % | 0,0 %  | 0,1 %  | 0,3 % | 0,1 %  | 0,3 % | 0,1 % | 0,3 %  | 0,0 % | 0,3 %  | -0,2 % | -0,1 % | 1,2 %   |
| 2017 | 0,4 % | -0,2 % | 0,9 %  | 0,2 % | 0,5 %  | 0,3 % | 0,3 % | 0,2 %  | 0,5 % | 0,5 %  | 0,4 %  | 0,3 %  | 4,4 %   |
| 2018 | 0,4 % | 0,5 %  | 0,3 %  | 0,3 % | -0,2 % | 0,3 % | 0,3 % | -0,1 % | 0,2 % | 0,2 %  | 0,0 %  | 0,4 %  | 2,6 %   |
| 2019 | 0,0 % | 0,2 %  | 0,0 %  | 0,5 % | 0,2 %  | 0,1 % | 0,5 % | -0,1 % | 0,3 % | 0,5 %  | 0,2 %  | 0,3 %  | 2,7 %   |
| 2020 | 0,4 % | 0,4 %  | -1,2 % | 0,3 % | 0,6 %  | 0,5 % | 0,5 % | 0,2 %  | 0,2 % | 0,4 %  | 0,1 %  | 0,2 %  | 2,6 %   |
| 2021 | 0,2 % | 0,2 %  | 0,3 %  | 0,2 % | -0,3 % | 0,0 % | 0,2 % | 0,2 %  | 0,1 % | -0,4 % | -1,0 % |        | -0,3 %  |

Wskaźniki statystyczne liczone są na bazie miesięcznych stóp zwrotu, za okres do 3 lat, na dzień 2021-10-31. Wykres notowań od: 2013-12-10 do: 2021-11-26.

## ~ 13 LAT HISTORII

Blisko 13 lat historii i doskonalenia procesu inwestycyjnego w obszarze funduszy dłużnych

## ALTERNATYWA DLA LOKAT

Bardzo dobre, wyniki, z roczną stopą zwrotu na poziomie oprocentowania lokat bankowych + 1-2 procent

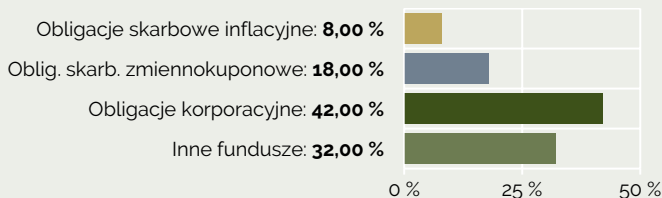
## DYWERSYFIKACJA I PŁYNNOŚĆ

Szeroka dywersyfikacja i płynność lokat

## STRUKTURA AKTYWÓW

### INSTRUMENTY

(2021-09-30)



### WALUTY

(2021-09-30)



## SŁOWNICZEK

**Benchmark** - punkt odniesienia dla oceny stóp zwrotu danego subfunduszu, biorący pod uwagę specyfikę jego polityki inwestycyjnej. **Alfa** - wskaźnik informujący o tym, o ile lepsze od benchmarku, w danym okresie, były wyniki funduszu. Dodatnia alfa wskazuje na przewagę funduszu nad benchmarkiem w badanym okresie. **Beta** - wskaźnik informujący o tym, czy zmienność funduszu jest większa, czy mniejsza od zmienności benchmarku. Fundusz z beta niższą od 1 charakteryzuje się mniejszą zmiennością, z kolei beta większe niż 1 oznacza, że fundusz jest bardziej zmienny niż benchmark. **R2** - jest to miara dopasowania danych. Wskaźnik ten mierzy w jakim zakresie wynik funduszu kierowany jest przez benchmark. R2 równe 0,5 oznacza, że 50% historycznego zachowania funduszu przypisywane jest benchmarkowi. **Tracking error** - oczekiwane maksymalne odchylenie standardowe zysków funduszu od benchmarku. **Odchylenie standardowe** - informuje jak roczne zwroty z funduszu mogą różnić się od średniego rocznego zwrotu w długim okresie. Im większe odchylenie standardowe, tym większa zmienność funduszu. **IR** - (Information Ratio) to miara efektywności zarządzania. Wyraża ona relację oczekiwanej dodatkowej stopy zwrotu do ryzyka, mierzonego odchyleniem standardowym dodatkowych stóp zwrotu, które to miary są związane z ocenianym funduszem. Wskaźnik o wartości z przedziału 0,50-0,75 uważa się za dobry, 0,76-1,00 za bardzo dobry, a powyżej 1 za wyjątkowo dobry. **Wskaźnik Sharpe'a** - jest miarą oceny pochodną ryzyka całkowitego. Dodatkowa stopa zwrotu jest to nadwyżka zysku jaką daje dany fundusz ponad stopę wolną od ryzyka. Wskaźnik ten pozwala wybrać fundusz o najwyższej stopie zwrotu przy minimalnym ryzyku - dodatnia wartość wskaźnika. Jeżeli wskaźnik jest ujemny wówczas świadczy to, że zysk z funduszu jest niższy niż rynkowa stopa wolna od ryzyka.

## 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 braku wykonania przez kontrahenta zobowiązań umownych. **Ryzyko płynności** jest związane z brakiem możliwości wyceny lub zbycia instrumentów finansowych w pożądanym czasie i miejscu. **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. **Ryzyko kredytowe** związane jest z możliwością bezpośredniego oraz pośredniego inwestowania w dłużne papiery wartościowe, w tym obligacje przedsiębiorstw. Szczegółowe informacje związane z uczestnictwem w subfunduszach wydzielonych w ramach Superfund Funduszu Inwestycyjnego Otwartego Portfelowego, 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\\_FIO\\_Portfelowy\\_Proспект.pdf](https://superfund.pl/files/Superfund_FIO_Portfelowy_Proспект.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/Superfund\\_FIO\\_Portfelowy\\_Spokojna\\_Inwestycja\\_KIID.pdf](https://superfund.pl/files/Superfund_FIO_Portfelowy_Spokojna_Inwestycja_KIID.pdf). Roczne sprawozdanie finansowe subfunduszu dostępne jest w języku polskim na stronie internetowej Towarzystwa pod adresem: [https://superfund.pl/files/Superfund\\_FIO\\_Portfelowy\\_Spokojna\\_inwestycja\\_Roczne\\_2020.pdf](https://superfund.pl/files/Superfund_FIO_Portfelowy_Spokojna_inwestycja_Roczne_2020.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. 93a dyrektywy 2009/65/WE. 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 wahaniom 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.



SUPERFUND TFI S.A. zarejestrowane w rejestrze przedsiębiorców Krajowego Rejestru Sądowego Sąd Rejonowy dla m. st. Warszawy, XII Wydział Gospodarczy Krajowego Rejestru Sądowego pod numerem KRS 0000234965, NIP 1070002513, REGON 140147499, wysokość kapitału zakładowego: 2 210 000 złotych (wpłacony w całości).

## KONTAKT

Infolinia  
**22 556 88 62**  
[www.superfund.pl](http://www.superfund.pl)