

STRATEGIA INWESTYCYJNA

Superfund RED, subfundusz wydzielony w ramach Superfund Specjalistycznego Funduszu Inwestycyjnego Otwartego, lokuje do 100% swoich aktywów w Superfund RED Sicav („fundusz bazowy”). Dzięki temu pośrednio stosuje innowacyjną strategię inwestycyjną, która wyróżnia go na tle tradycyjnych form inwestowania, oferując alternatywne podejście do budowy portfela. Subfundusz może stanowić skuteczny sposób na zwiększenie różnorodności portfela inwestycyjnego, zapewniając elastyczność w zmiennych warunkach rynkowych. Należy jednak pamiętać, że każdorazowo inwestor powinien brać pod uwagę ryzyka związane z inwestycją. Strategia funduszu bazowego opiera się na zasadzie podążania za trendami. System monitoruje ruchy cen na rynkach, koncentrując się na krótkoterminowych zmianach, niezależnie od średnio- i długoterminowych trendów. W związku z tym fundusz bazowy dąży do generowania dodatnich stóp zwrotu niezależnie od kierunku zmian na rynku. Trzeba jednak uwzględnić, że wyniki inwestycyjne mogą podlegać znacznym wahaniom, a osiągnięcie dodatnich stóp zwrotu nie jest gwarantowane. Ze względu na charakter strategii funduszu bazowego, Superfund RED cechuje się nieprzewidywalnością stóp zwrotu. Fundusz bazowy wykorzystuje własne, w pełni zautomatyzowane systemy transakcyjne, które inwestują na około 60 międzynarodowych rynkach kontraktów terminowych. Takie podejście zapewnia dywersyfikację oraz umożliwia szybkie, pozbawione emocji reagowanie na sygnały rynkowe. Informacje marketingowe zawarte w karcie subfunduszu Superfund RED dotyczą jednostki funduszu kategorii A.

PODSTAWOWE INFORMACJE



Typ funduszu: **Absolutnej stopy zwrotu**
Data uruchomienia: **2013-05-06**
Horyzont inwestycyjny: **6 lat**
Min. pierwsza wpłata (os. prawne): **500 PLN**
Min. pierwsza wpłata (os. fizyczne): **równowartość 40 000 EUR**
Min. kolejna wpłata: **500 PLN**
Opłata za nabycie: **4,00 %**
Opłata za odkupienie: **0,00 %**
Opłata za zarządzanie: **1,20 %**
Waluta: **PLN, EUR, USD**
Rachunek nabycia PLN: **08 1600 0003 1735 3341 5000 0006**
Rachunek nabycia EUR: **78 1600 0003 1735 3341 5000 0007**
Rachunek nabycia USD: **51 1600 0003 1735 3341 5000 0008**

PROFIL RYZYKA

1 2 3 4 5 6 7

WYNIKI



Wykres notowań od: 2013-05-06 do: 2025-03-31.

STATYSTYKA

Alpha: **-2,36 %**
Beta: **0,6088**
R²: **40,92 %**
Tracking Error: **16,10 %**
Odchylenie standardowe: **5,33 %**
Sharpe ratio: **-0,3929 (WIBID 1M)**
IR: **-2,1183**
Wskaźniki statystyczne liczone są na bazie miesięcznych stóp zwrotu, za okres do 3 lat, na dzień 2025-03-31.

	1M	3M	6M	12M	36M	60M	120M	YTD
Superfund Red kat. A PLN	-0,49 %	-0,31 %	-16,85 %	-26,43 %	-46,83 %	-56,20 %	-69,91 %	-0,31 %

	Sty	Lut	Mar	Kwi	Maj	Cze	Lip	Sie	Wrz	Paź	Lis	Gru	Sty-Gru
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 %	-8,9 %	2,9 %	4,6 %	7,6 %	-1,6 %
2024	-7,4 %	0,8 %	0,8 %	-2,0 %	-2,3 %	0,9 %	-5,5 %	-1,2 %	-1,9 %	-3,0 %	-2,1 %	-12,2 %	-30,6 %
2025	0,2 %	-0,1 %	-0,5 %										-0,3 %

Stopy zwrotu na dzień 2025-03-31.

SYSTEM TRANSAKCYJNY

Inwestycja w oparciu o autorski system transakcyjny.

ŚLEDZENIE TRENDÓW

Koncentracja na wykrywaniu jasno zdefiniowanych krótkoterminowych trendów inwestycyjnych.

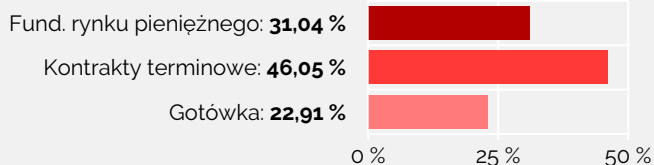
DYWERSYFIKACJA

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

STRUKTURA AKTYWÓW

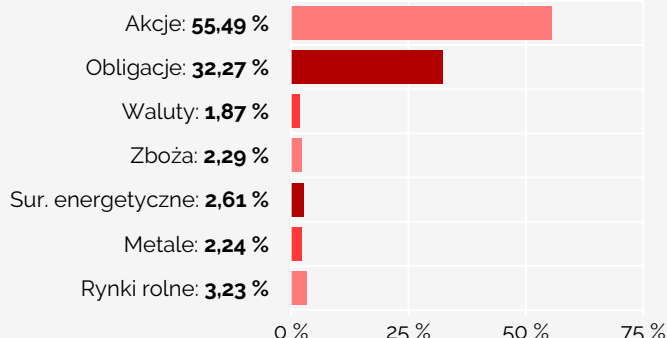
INSTRUMENTY

(2024-12-30 - dot. funduszu bazowego)



KONTRAKTY TERMINOWE

(2024-12-30 - dot. funduszu bazowego)



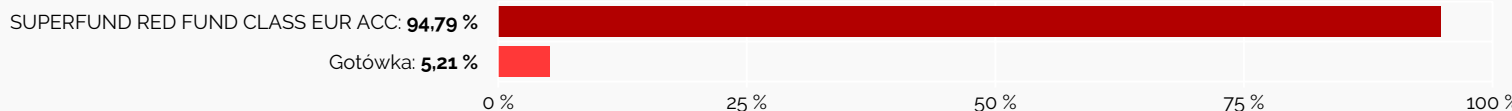
WALUTY

(2024-12-30 - dot. Superfund Red)



STRUKTURA AKTYWÓW SUPERFUND RED

(2024-12-30)



„Struktury aktywów”: publikowane są przez fundusz bazowy z częstotliwością kwartalną.

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/2025-04-07_KID_Superfund_RED_A.pdf. Roczne sprawozdanie finansowe subfunduszu dostępne jest w języku polskim na stronie internetowej Towarzystwa pod adresem: https://superfund.pl/files/Superfund_SFIO_Red_Roczne_2023.zip. 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.

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 oczekiwanego dodatkowego 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 ryzyka inwestycji. Stanowi on relację przeciętnej dodatkowej stopy zwrotu do odchylenia standardowego dodatkowej stopy zwrotu będące 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.



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: 2 320 000 złotych (wpłacony w całości).

KONTAKT

22 556 88 62
www.superfund.pl