

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.: (2022-09-01): **830.07**
 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

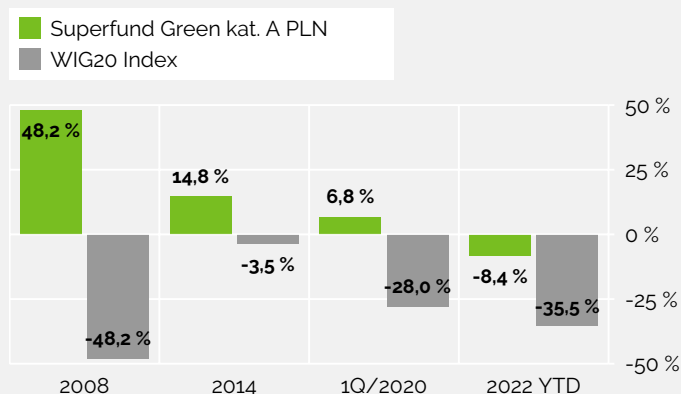


STATYSTYKA

Alpha: **0,04 %**
 Beta: **0,1076**
 R²: **4,30 %**
 Tracking Error: **26,09 %**
 Odchylenie standardowe: **3,80 % (benchmark: 7,34 %)**
 Sharpe ratio: **-0,0379 (WIBID 1M)**
 IR: **0,2871**

	1M	3M	6M	12M	36M	60M	120M	MTD	YTD
Superfund Green kat. A PLN	-9,73 %	-16,54 %	-10,72 %	-11,01 %	-4,91 %	-0,09 %	-0,50 %	-1,52 %	-8,39 %
WIG20 Index	-15,77 %	-19,75 %	-25,64 %	-38,32 %	-31,50 %	-42,14 %	-35,23 %	-4,72 %	-35,48 %

Wskaźniki statystyczne liczone są na bazie miesięcznych stóp zwrotu, za okres do 3 lat, na dzień 2022-08-31. Wykres notowań od: 2017-09-01 do: 2022-09-01.



SKUTECZNOŚĆ STRATEGII

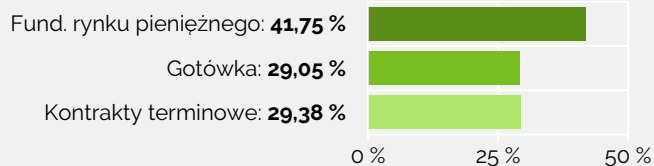
Jako najbardziej wymowny przykład skuteczności strategii managed futures, opracowanej i stosowanej przez Superfund, podajemy rok 2008. Na tle wszechobecných spadków na giełdach, fundusz Superfund B (obecnie Superfund Green) uzyskał stopę zwrotu +48,2%.

2008 - Kryzys hipoteczny
2014 - Rosyjska agresja wobec Ukrainy
1Q/2020 - Pandemia (pierwszy kwartał)
2022 YTD - Od początku obecnego roku

STRUKTURA AKTYWÓW

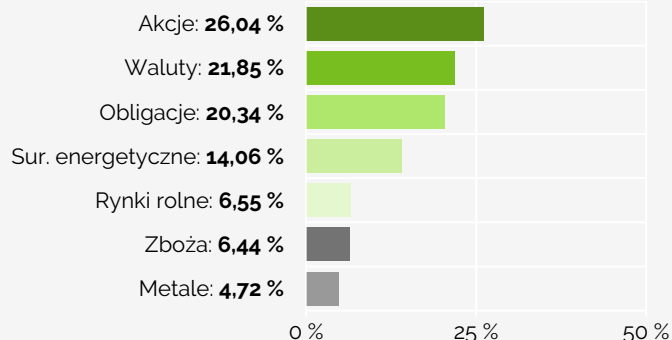
INSTRUMENTY

(2022-06-30 - funduszu bazowego)



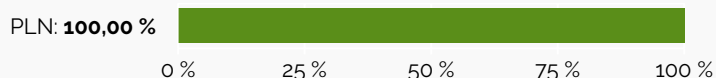
KONTRAKTY TERMINOWE

(2022-06-30 - funduszu bazowego)



WALUTY

(2022-06-30)



KOMENTARZ

W lutym 2022 nasilił się konflikt na linii Rosja-Ukraina, co należy odbierać jako największy konflikt zbrojny w Europie od 30 lat. Jest to na tyle bezprecedensowa sytuacja, że w ciągu kilku dni zareagował praktycznie cały świat nakładając sankcje na Rosję. Ryzyko geopolityczne na świecie znacząco wzrosło, szczególnie w środkowo-wschodniej części Europy i nie należy spodziewać się poprawy w tym zakresie w kolejnych miesiącach. Rynki finansowe w takim otoczeniu charakteryzują się podwyższoną zmiennością, co nie jest korzystne dla inwestorów. W ciągu dwóch pierwszych miesięcy 2022 roku amerykański indeks akcji S&P 500 stracił ponad 8%, natomiast polski WIG stracił ponad 11%. W takim otoczeniu rynkowym bardzo dobrze odnajduje się fundusz Superfund Green, który w tym samym okresie zyskał ponad 2%. Podobna sytuacja miała miejsce w ciągu pierwszego kwartału 2020 roku, kiedy to zaczęła się pandemia koronawirusa na świecie. S&P 500 stracił wtedy 20%, natomiast WIG spadł 28%. W tym czasie Superfund Green zyskał 6,8%. Największą zaletą tego funduszu jest szeroka dywersyfikacja oraz elastyczność strategii. Dzięki temu fundusz charakteryzuje się brakiem korelacji z innymi rynkami, więc jego strategia pozwala zarabiać niezależnie od sytuacji na rynkach.

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 subfunduszu 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/Superfund_SFIO_Green_KIID.pdf. Roczne sprawozdanie finansowe subfunduszu dostępne jest w języku polskim na stronie internetowej Towarzystwa pod adresem: https://superfund.pl/files/Superfund_SFIO_Green_Roczne_2021.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.