

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

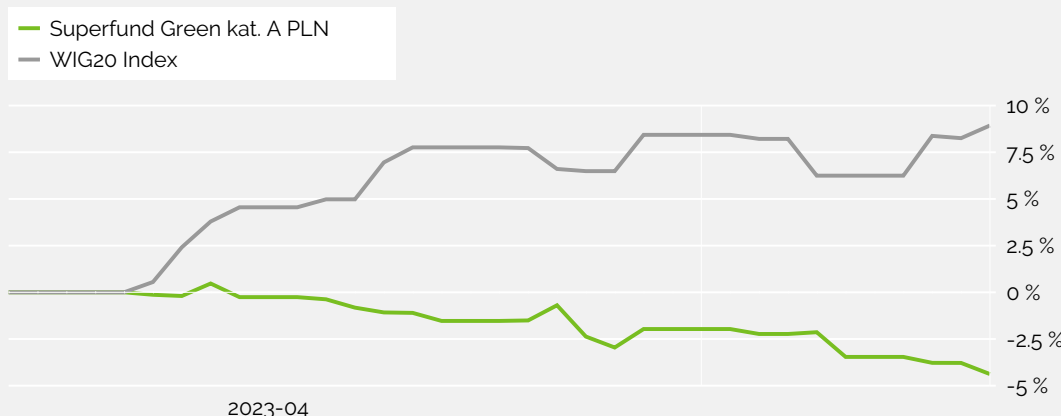


Typ funduszu: **Absolutnej stopy zwrotu**
 Data uruchomienia: **2005-12-13**
 Aktualna wartość j.u.: (2023-05-10): **602.11**
 Horyzont inwestycyjny: **3 lata**
 Min. pierwsza wpłata (os. prawne): **500 PLN**
 Min. pierwsza wpłata (os. fizyczne): **równowartość 40 000 EUR**
 Min. kolejna wpłata: **500 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: **-1,10 %**
 Beta: **0,0934**
 R²: **2,39 %**
 Tracking Error: **27,96 %**
 Odchylenie standardowe: **4,49 % (benchmark: 7,44 %)**
 Sharpe ratio: **-0,2779 (WIBID 1M)**
 IR: **-0,7408**

	1M	3M	6M	12M	36M	60M	120M	MTD	YTD
Superfund Green kat. A PLN	-4,38 %	-13,28 %	-25,00 %	-40,64 %	-34,91 %	-32,61 %	-33,87 %	-2,46 %	-20,72 %
WIG20 Index	8,93 %	4,54 %	14,29 %	12,37 %	20,26 %	-16,10 %	-17,37 %	0,46 %	7,81 %

	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 %	-2,5 %								-20,7 %

Wskaźniki statystyczne liczone są na bazie miesięcznych stóp zwrotu, za okres do 3 lat, na dzień 2023-04-30. Wykres notowań od: 2023-04-06 do: 2023-05-10.

SYSTEM TRANSAKCYJNY

Inwestycja w oparciu o autorski system transakcyjny.

ŚLEDZENIE TRENDÓW

Koncentracja na wykrywaniu jasno zdefiniowanych trendów inwestycyjnych.

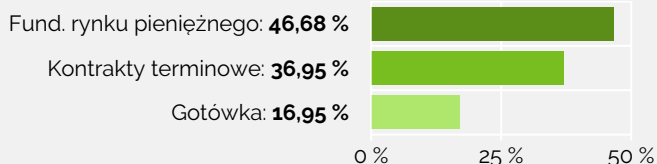
DYWERSYFIKACJA

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

STRUKTURA AKTYWÓW

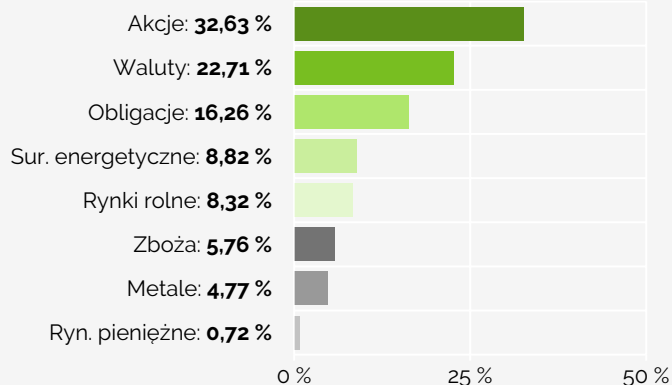
INSTRUMENTY

(2023-03-31 - funduszu bazowego)



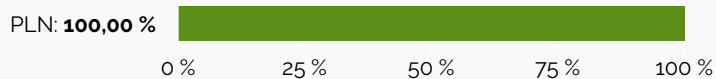
KONTRAKTY TERMINOWE

(2023-03-31 - funduszu bazowego)



WALUTY

(2023-03-31)



KOMENTARZ

Kwiecień był względnie udany dla funduszu Superfund Green. Przez większą część miesiąca notował on dodatnią stopę zwrotu, by miesiąc zakończyć na symbolicznym minusie wynoszącym -0,96%. Fundusz w kwietniu nie posiadał żadnej dominującej pozycji na głównych klasach aktywów, które mogłyby przesądzić o jego stopie zwrotu, a pozycjonowanie portfolio było dość neutralne. Pozytywnie wpływały długie pozycje na indeksach akcji, metalach szlachetnych oraz krótkie pozycje na obligacjach państw europejskich, w których cykl podnoszenia stóp procentowych jeszcze nie został zakończony, tym samym skutecznie przyczyniając się do obniżenia cen europejskich obligacji. Ujemnie kontrybuowały do wyniku pozycje na surowcach energetycznych oraz płodach rolnych.

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_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. 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 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.