

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.: (2023-10-31): **529.94**
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



Wykres notowań od: 2005-12-13 do: 2023-10-31.

STATYSTYKA

Alpha: **-1,17 %**
Beta: **0,0494**
R²: **0,72 %**
Tracking Error: **29,67 %**
Odchylenie standardowe: **4,48 %**
Sharpe ratio: **-0,3150 (WIBID 1M)**
IR: **-0,9558**

Wskaźniki statystyczne liczone są na bazie miesięcznych stóp zwrotu, za okres do 3 lat, na dzień 2023-10-31.

			1M	3M	6M	12M	36M	60M	120M	YTD			
Superfund Green kat. A PLN			-5,99 %	-11,93 %	-14,15 %	-35,67 %	-35,43 %	-25,51 %	-34,81 %	-30,23 %			
	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 %	0,6 %	-1,5 %	-1,7 %	-8,3 %	2,2 %	-6,0 %			-30,2 %

Stopy zwrotu na dzień 2023-10-31.

SYSTEM TRANSAKCYJNY

Inwestycja w oparciu o autorski system transakcyjny.

ŚLEDZENIE TRENDÓW

Koncentracja na wykrywaniu jasno zdefiniowanych trendów inwestycyjnych.

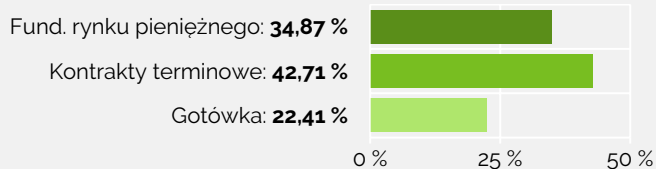
DYWERSYFIKACJA

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

STRUKTURA AKTYWÓW

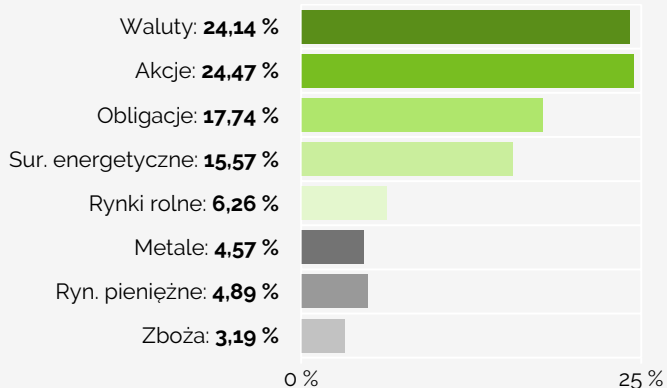
INSTRUMENTY

(2023-09-30 - funduszu bazowego)



KONTRAKTY TERMINOWE

(2023-09-30 - funduszu bazowego)



WALUTY

(2023-09-30)



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_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 przedsięwzięcia 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.