

## STRATEGIA INWESTYCYJNA

Superfund Green, subfundusz wydzielony w ramach Superfund Specjalistycznego Funduszu Inwestycyjnego Otwartego, lokuje do 100% swoich Aktywów w Superfund Green Sicav („fundusz bazowy”), dzięki czemu pośrednio stosuje innowacyjną strategię inwestycyjną, która odróżnia go od tradycyjnych form inwestowania, oferując alternatywne podejście do budowania portfela. Fundusz może stanowić skuteczny sposób na zwiększenie różnorodności portfela inwestycyjnego, zapewniając elastyczność w zmiennych warunkach rynkowych. Strategia funduszu bazowego opiera się na zasadzie podążania za trendami. System monitoruje ruchy cen na rynkach i identyfikuje okazje inwestycyjne, aby maksymalnie wykorzystać potencjał występujących trendów. W związku z tym fundusz bazowy dąży do generowania dodatnich stóp zwrotu niezależnie od kierunku zmian na rynku, ale należy wziąć pod uwagę, iż wyniki inwestycyjne mogą podlegać wahaniom, a osiągnięcie dodatnich stóp zwrotu nie jest zagwarantowane. Ze względu na charakter strategii funduszu bazowego Superfund Green cechuje się nieprzewidywalnością stóp zwrotu. Fundusz bazowy korzysta z własnych, w pełni zautomatyzowanych systemów transakcyjnych, które inwestują na około 150 międzynarodowych rynkach kontraktów terminowych. Takie podejście zapewnia dywersyfikację oraz umożliwia szybkie i pozbawione emocji reagowanie na sygnały rynkowe. Informacje przedstawione w karcie funduszu Superfund Green dotyczą jednostki funduszu kategorii A.

## PODSTAWOWE INFORMACJE



Typ funduszu: **Absolutnej stopy zwrotu**  
Data uruchomienia: **2005-12-13**  
Aktualna wartość j.u.: (2024-10-31): **510.29**  
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: **41 1600 0003 1735 6228 0000 0006**  
Rachunek nabycia EUR: **14 1600 0003 1735 6228 0000 0007**  
Rachunek nabycia USD: **84 1600 0003 1735 6228 0000 0008**

## PROFIL RYZYKA

1 2 3 4 5 6 7

## WYNIKI

Superfund Green kat. A PLN



Wykres notowań od: 2005-12-13 do: 2024-10-31.

## STATYSTYKA

Alpha: **-1,61 %**  
Beta: **0,0716**  
R<sup>2</sup>: **1,10 %**  
Tracking Error: **27,13 %**  
Odchylenie standardowe: **4,64 %**  
Sharpe ratio: **-0,4452 (WIBID 1M)**  
IR: **-0,7046**  
Wskaźniki statystyczne liczone są na bazie miesięcznych stóp zwrotu, za okres do 3 lat, na dzień 2024-10-31.

	1M	3M	6M	12M	36M	60M	120M	YTD
Superfund Green kat. A PLN	-3,87 %	-6,42 %	-14,84 %	-3,71 %	-46,39 %	-37,46 %	-41,36 %	-8,57 %

	Sty	Lut	Mar	Kwi	Maj	Cze	Lip	Sie	Wrz	Paź	Lis	Gru	Sty-Gru
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 %	0,5 %	4,8 %	-26,5 %
2024	-4,3 %	5,0 %	6,9 %	0,0 %	-5,1 %	1,7 %	-5,7 %	-4,2 %	1,6 %	-3,9 %			-8,6 %

Stopy zwrotu na dzień 2024-10-31.

## SYSTEM TRANSAKCYJNY

Inwestycja w oparciu o autorski system transakcyjny.

## ŚLEDZENIE TRENDÓW

Koncentracja na wykrywaniu jasno zdefiniowanych trendów inwestycyjnych.

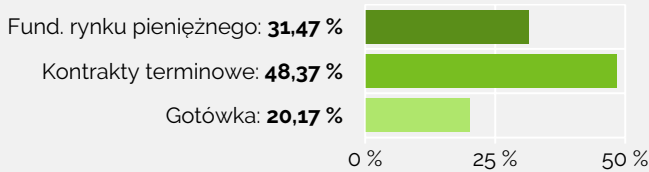
## DYWERSYFIKACJA

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

## STRUKTURA AKTYWÓW

### INSTRUMENTY

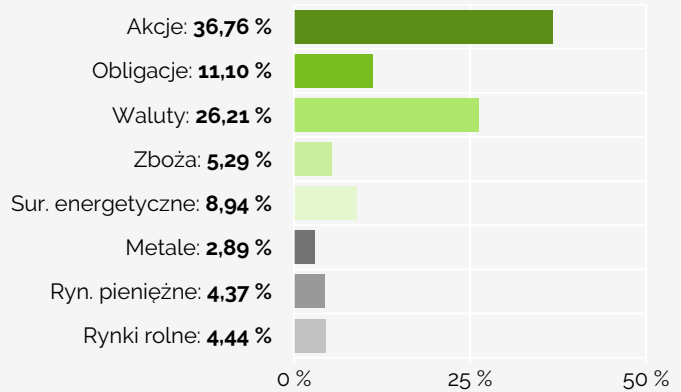
(2024-09-30 - funduszu bazowego)



Suma struktury aktywów funduszu wynosi 100,01%, a nie 100,00. Wynika to z zaokrąglenia w górę struktury aktywów w funduszu bazowym.

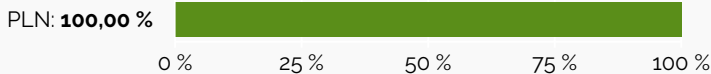
### KONTRAKTY TERMINOWE

(2024-09-30 - funduszu bazowego)



### WALUTY

(2024-09-30)



**Dane dotyczące „Struktury aktywów”:** publikowane są przez fundusz bazowy z częstotliwością miesięczną, zazwyczaj w ciągu dwóch tygodni po zakończeniu miesiąca.

Październik zakończył się dla funduszu Superfund Green wynikiem -3,87%. Wierzymy jednak, że w przyszłości fundusz będzie generować pozytywne stopy zwrotu, zwłaszcza że algorytm zarządzający funduszem, w ramach strategii managed futures, dynamicznie dostosowuje krótkie oraz długie pozycje na głównych klasach aktywów w odpowiedzi na zmieniające się trendy cenowe. Oczekujemy, że w kolejnych okresach strategia zarządzająca portfelem funduszu będzie wykorzystywać średnioterminowe trendy cenowe, co pozwoli na dostarczenie uczestnikom dodatnich wyników inwestycyjnych.

## 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 realizować 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](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/20240913\\_Superfund\\_SFIO\\_Green\\_KID.pdf](https://superfund.pl/files/20240913_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\\_2023.zip](https://superfund.pl/files/Superfund_SFIO_Green_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 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.



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](http://www.superfund.pl)