

## STRATEGIA INWESTYCYJNA

Superfund GoldFuture, subfundusz wydzielony w ramach Superfund Specjalistycznego Funduszu Inwestycyjnego Otwartego, lokuje do 100% swoich aktywów w tytuły uczestnictwa Class Gold, emitowane przez fundusz Superfund Sicav („fundusz bazowy”). Dzięki temu fundusz pośrednio stosuje zaawansowaną strategię inwestycyjną opartą na rynku złota, oferując alternatywne podejście do tradycyjnych metod inwestowania. Fundusz bazowy wykorzystuje strategię typu managed futures, opierającą się na algorytmach identyfikujących i podążających za trendami rynkowymi. System ten śledzi zmiany cen na różnych rynkach, w tym złota, a także kontraktów terminowych, akcji, obligacji, towarów oraz walut, zapewniając szeroką dywersyfikację. Podejście funduszu bazowego eliminuje wpływ emocji na decyzje inwestycyjne, a także umożliwia szybkie reakcje na sygnały rynkowe. Superfund GoldFuture może stanowić skuteczny sposób na zwiększenie różnorodności portfela inwestycyjnego, zwłaszcza w zmiennych warunkach rynkowych. Celem funduszu bazowego jest generowanie dodatnich stóp zwrotu niezależnie od kierunku zmian na rynku, jednakże wyniki inwestycyjne mogą ulegać wahaniom i nie ma gwarancji osiągnięcia dodatnich zwrotów. Fundusz ten, z racji swojej strategii, charakteryzuje się wysoką zmiennością stóp zwrotu, co może znacząco wpływać na wycenę jednostek uczestnictwa. Informacje przedstawione dotyczą jednostki funduszu kategorii A.

## PODSTAWOWE INFORMACJE



Typ funduszu: **Rynku surowców - metale szlachetne**  
 Data uruchomienia: **2007-10-17**  
 Aktualna wartość j.u.: (2024-10-31): **516.29**  
 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: **2,00 %**  
 Waluta: **PLN, EUR, USD**  
 Rachunek nabycia PLN: **43 1600 0003 1735 6264 2000 0006**  
 Rachunek nabycia EUR: **16 1600 0003 1735 6264 2000 0007**  
 Rachunek nabycia USD: **86 1600 0003 1735 6264 2000 0008**

## PROFIL RYZYKA

1 2 3 4 5 6 7

## WYNIKI



Wykres notowań od: 2007-10-17 do: 2024-10-31.

## STATYSTYKA

Alpha: **-1,51 %**  
 Beta: **0,6093**  
 R<sup>2</sup>: **17,30 %**  
 Tracking Error: **17,79 %**  
 Odchylenie standardowe: **5,42 %**  
 Sharpe ratio: **-0,2203 (WIBID 1M)**  
 IR: **-1,3495**  
 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 GoldFuture kat. A PLN	0,50 %	6,23 %	-2,62 %	25,22 %	-27,17 %	-8,68 %	-11,93 %	15,44 %

	Sty	Lut	Mar	Kwi	Maj	Cze	Lip	Sie	Wrz	Paź	Lis	Gru	Sty-Gru
2019	5,6 %	4,4 %	-0,3 %	2,9 %	-3,8 %	11,8 %	3,9 %	12,5 %	-7,0 %	-2,4 %	1,2 %	4,6 %	36,6 %
2020	8,1 %	2,3 %	0,7 %	7,2 %	-5,4 %	-0,7 %	11,3 %	0,2 %	-9,9 %	-5,3 %	-3,2 %	5,6 %	9,0 %
2021	0,4 %	4,6 %	-7,2 %	6,7 %	9,1 %	-8,9 %	6,5 %	-3,0 %	-5,7 %	7,8 %	-6,3 %	2,0 %	3,8 %
2022	-1,8 %	8,1 %	7,8 %	-0,3 %	-0,9 %	-10,3 %	-4,1 %	-10,2 %	-2,8 %	-4,3 %	0,7 %	0,7 %	-17,7 %
2023	-1,2 %	-3,5 %	-7,5 %	-0,9 %	-1,1 %	-4,0 %	0,5 %	-9,5 %	-2,3 %	0,2 %	2,3 %	6,0 %	-19,7 %
2024	-6,9 %	4,7 %	14,4 %	6,3 %	-5,6 %	0,4 %	-3,3 %	-0,2 %	5,9 %	0,5 %			15,4 %

Stopy zwrotu na dzień 2024-10-31.

## BEZPIECZNA PRZYSTAŃ

Inwestycja w złoto w niepewnych czasach traktowane jest jako "bezpieczna przystań"

## DIWERSYFIKACJA

Dodatkowo globalnie zdywersyfikowany portfel z ekspozycją na akcje, obligacje, waluty i surowce

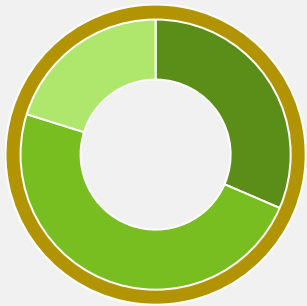
## ZŁOTO + MANAGED FUTURES

Superfund Sicav Class Gold jest połączeniem inwestycji w złoto i strategii managed futures (Superfund Green)

## STRUKTURA AKTYWÓW

### INSTRUMENTY

(2024-09-30 - funduszu bazowego)

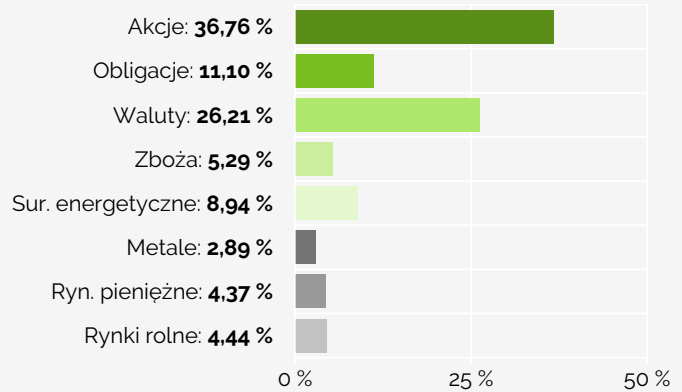


- 100 % Złoto (futures)
- 31.47 % Fund. rynku pieniężnego
- 48.37 % Kontrakty terminowe
- 20.17 % Gotówka

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

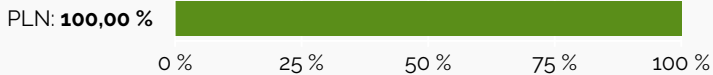
### KONTRAKTY TERMINOWE

(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.

## 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](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\\_GoldFuture\\_KID.pdf](https://superfund.pl/files/20240913_Superfund_SFIO_GoldFuture_KID.pdf). Roczne sprawozdanie finansowe subfunduszu dostępne jest w języku polskim na stronie internetowej Towarzystwa pod adresem: [https://superfund.pl/files/Superfund\\_SFIO\\_GoldFuture\\_Roczne\\_2023.zip](https://superfund.pl/files/Superfund_SFIO_GoldFuture_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 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.