SUPERFUND OBLIGACYJNY

2022-03-03

SUPERFUND THE FUTURE OF INVESTING

STRATEGIA INWESTYCYJNA

Superfund Obligacyjny inwestuje bezpośrednio i pośrednio w instrumenty dłużne. Portfel inwestycyjny jest zbalansowany między inwestycjami na rynku obligacji przedsiębiorstw i obligacji skarbowych inflacyjnych. W efekcie do 50% aktywów jest ulokowana w obligacje korporacyjne emitentów o atrakcyjnym oprocentowaniu i solidnym modelu biznesowym, a pozostała część w obligacjach skarbowych inflacyjnych. Taka alokacja pozwala czerpać korzyści z ekspozycji na ryzyko kredytowe oraz jednocześnie utrzymywać znaczące zaangażowanie na rynku długu skarbowego, gdzie łatwość upłynnienia aktywów jest wyższa. W środowisku rekordowo niskich stóp procentowych znaczące zaangażowanie w obligacje korporacyjne, daje funduszowi potencjał do generowania wyższych stóp zwrotu.

PODSTAWOWE INFORMACJE

Fundusz stosuje Dobre Praktyki Informacyjne

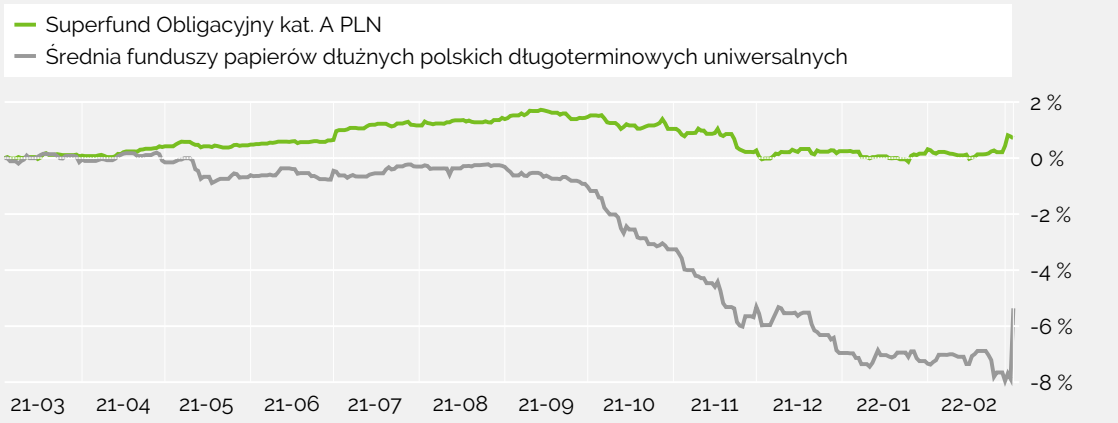
Typ funduszu: **Papierów dłużnych polskich długoterminowych uniwersalnych**
Data uruchomienia: **2013-12-10**
Aktualna wartość j.u.: (2022-03-03): **115.13**
Horyzont inwestycyjny: **1 rok**
Min. pierwsza wpłata: **100 PLN**
Min. kolejna wpłata: **100 PLN**
Opłata za nabycie: **0,50 %**
Opłata za odkupienie: **0,00 %**
Opłata za zarządzanie: **0,95 %**
Waluta: **PLN**
Rachunek nabycia PLN: **36 1880 0009 0000 0013 0090 4002**

PROFIL RYZYKA

1 **2** 3 4 5 6 7

WYNIKI

5 12M Ranking AOL | 5 36M Ranking AOL | ★★★★☆ Rating DM BOŚ S.A.



STATYSTYKA

Alpha: **0,15 %**
Beta: **0,4075**
R^2: **42,96 %**
Tracking Error: **2,07 %**
Odchylenie std.: **0,49 %**
Sharpe ratio: **0,1241**
IR: **1,0971**

	1M	3M	6M	12M	36M	60M	MTD	YTD	MAX
Superfund Obligacyjny kat. A PLN	0,55 %	0,73 %	-0,80 %	0,71 %	4,87 %	10,88 %	0,27 %	0,46 %	14,99 %

	Sty	Lut	Mar	Kwi	Maj	Cze	Lip	Sie	Wrz	Paź	Lis	Gru	Sty-Gru
2017	0,0 %	-0,9 %	0,6 %	0,5 %	0,9 %	0,0 %	0,2 %	0,0 %	0,5 %	0,2 %	0,4 %	0,3 %	2,6 %
2018	0,0 %	0,5 %	0,4 %	0,1 %	-0,3 %	0,1 %	0,5 %	-0,3 %	0,4 %	0,3 %	0,0 %	0,2 %	1,9 %
2019	0,2 %	0,0 %	0,3 %	-0,1 %	0,6 %	0,1 %	0,8 %	0,5 %	-0,1 %	0,3 %	-0,2 %	0,0 %	2,5 %
2020	0,2 %	1,5 %	-1,3 %	0,6 %	0,6 %	-0,2 %	0,3 %	0,1 %	0,1 %	0,8 %	-0,6 %	0,0 %	2,0 %
2021	0,1 %	-0,5 %	0,2 %	0,3 %	0,1 %	0,2 %	0,5 %	0,2 %	0,1 %	-0,4 %	-0,8 %	0,0 %	-0,1 %
2022	0,1 %	0,1 %	0,3 %										0,5 %

Wskaźniki statystyczne liczone są na bazie miesięcznych stóp zwrotu, za okres do 3 lat, na dzień 2022-02-28. Wykres notowań od: 2021-03-03 do: 2022-03-03.

ELASTYCZNA KONSTRUKCJA

Inwestycje zarówno na rynku obligacji skarbowych, jak i korporacyjnych

SZEROKA DYWERSYFIKACJA

Inwestycje w Polsce, jak i na rynkach zagranicznych

NISKI POZIOM RYZYKA

Niska zmienność i stabilne wyniki

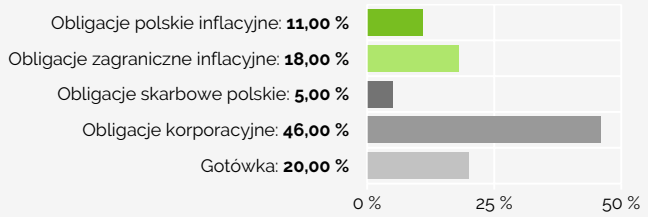
SUPERFUND OBLIGACYJNY

SUPERFUND THE FUTURE OF INVESTING

STRUKTURA AKTYWÓW

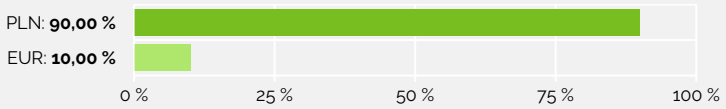
INSTRUMENTY

(2021-12-31)



WALUTY

(2021-12-31)



SŁOWNICZEK

Benchmark - punkt odniesienia dla oceny stóp zwrotu danego subfunduszu, biorący pod uwagę specyfikę jego polityki inwestycyjnej. **Alfa** - wskaźnik informujący o tym, o ile lepsze od benchmarku, w zadanym okresie, były wyniki funduszu. Dodatnia alfa wskazuje na przewagę funduszu nad benchmarkiem w badanym okresie. **Beta** - wskaźnik informujący o tym, czy zmienność funduszu jest większa, czy mniejsza od zmienności benchmarku. Fundusz z betą niższą od 1 charakteryzuje się mniejszą zmiennością, z kolei beta większe niż 1 oznacza, że fundusz jest bardziej zmienny niż benchmark. **R2** – jest to miara dopasowania danych. Wskaźnik ten mierzy w jakim zakresie wynik funduszu kierowany jest przez benchmark. R2 równe 0,5 oznacza, że 50% historycznego zachowania funduszu przypisywane jest benchmarkowi. **Tracking error** – oczekiwane maksymalne odchylenie standardowe zysków funduszu od benchmarku. **Odchylenie standardowe** – informuje jak roczne zwroty z funduszu mogą różnić się od średniego rocznego zwrotu w długim okresie. Im większe odchylenie standardowe, tym większa zmienność funduszu. **IR** - (Information Ratio) to miara efektywności zarządzania. Wyraża ona relację oczekiwanej dodatkowej stopy zwrotu do ryzyka, mierzonego odchyleniem standardowym dodatkowych stóp zwrotu, które to miary są związane z ocenianym funduszem. Wskaźnik o wartości z przedziału 0,50-0,75 uważa się za dobry, 0,76-1,00 za bardzo dobry, a powyżej 1 za wyjątkowo dobry. **Wskaźnik Sharpe'a** –jest miarą oceny ryzyka inwestycji. Stanowi on relację przeciętnej dodatkowej stopy zwrotu do odchylenia standardowego dodatkowej stopy zwrotu będące pochodną ryzyka całkowitego. Dodatkowa stopa zwrotu jest to nadwyżka zysku jaką daje dany fundusz ponad stopę wolną od ryzyka. Wskaźnik ten pozwala wybrać fundusz o najwyższej stopie zwrotu przy minimalnym ryzyku – dodatnia wartość wskaźnika. Jeżeli wskaźnik jest ujemny wówczas świadczy to, że zysk z funduszu jest niższy niż rynkowa stopa wolna od ryzyka.

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 braku wykonania przez kontrahenta zobowiązań umownych. **Ryzyko płynności** jest związane z brakiem możliwości wyceny lub zbycia instrumentów finansowych w pożądanym czasie i miejscu. **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. **Ryzyko kredytowe** związane jest z możliwością bezpośredniego oraz pośredniego inwestowania w dłużne papiery wartościowe, w tym obligacje przedsiębiorstw. Szczegółowe informacje związane z uczestnictwem w subfunduszach wydzielonych w ramach Superfund Funduszu Inwestycyjnego Otwartego Portfelowego, 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_FIO_Portfelowy_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_FIO_Portfelowy_Obligacyjny_KIID.pdf. Roczne sprawozdanie finansowe subfunduszu dostępne jest w języku polskim na stronie internetowej Towarzystwa pod adresem: https://superfund.pl/files/Superfund_FIO_Portfelowy_Obligacyjny_Roczne_2020.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. 93a dyrektywy 2009/65/WE. Towarzystwo zwraca uwagę, że jakiekolwiek 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 wahaniom 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.