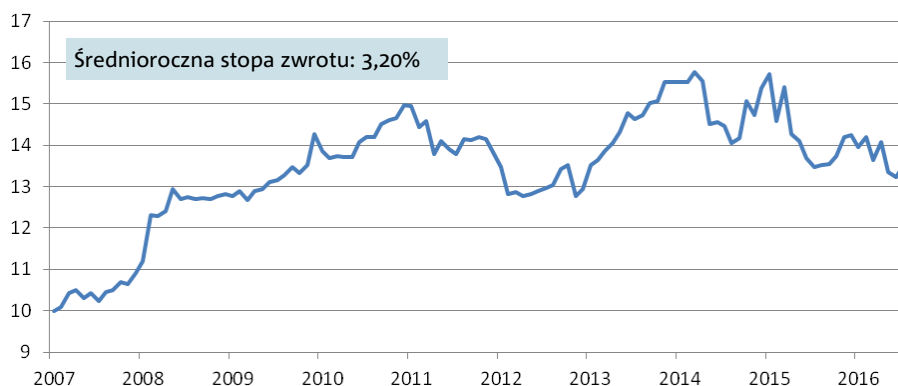


Superfund Blue – strategia equity market neutral

Superfund Blue to fundusz typu equity market neutral, czyli fundusz inwestujący na rynku akcji poprzez równoczesny zakup i sprzedaż udziałów w różnych spółkach.

Transakcje w strategii equity market neutral polegają na kupnie akcji jednej spółki i sprzedaży akcji innej spółki np.: kupujemy akcje Volkswagena, a sprzedajemy akcje Peugeot. Zajmując taką pozycję oczekujemy, że akcje Volkswagena będą zachowywać się lepiej niż akcje konkurenta bez względu na to czy na rynku będą dominować wzrosty czy spadki. Innym przykładem transakcji jest kupno akcji i sprzedaż kontraktów na indeks giełdowy. W tym przypadku zakładamy, że akcje danej spółki będą zachowywać się lepiej niż rynek bez względu na koniunkturę na giełdzie. Taka strategia, zabezpieczająca inwestorów przed ogólną dekoniunkturą na rynku akcji, nie jest sama w sobie nowością, unikalną cechą funduszu Superfund Blue jest jednak oparcie decyzji inwestycyjnych w 100% na zautomatyzowanych algorytmach komputerowych, pozwalających w pełni uniezależnić proces decyzyjny od emocjonalnych ludzkich decyzji, eliminując ryzyka z tym związane.

Superfund Blue oferuje klientom ekspozycję na globalne rynki akcji. Fundusz inwestuje w wybrane akcje z uniwersum 3500 najbardziej płynnych spółek dostępnych na rynkach akcji. Decyzje inwestycyjne są podejmowane przez systemy komputerowe, które inicjują sygnały kupna i sprzedaży na podstawie analizy technicznej. Transakcje są dokonywane tylko wówczas, gdy istnieje duże prawdopodobieństwo osiągnięcia zysku w horyzoncie od jednego dnia do tygodnia. Krótki horyzont inwestycyjny i ścisłe zasady podejmowania decyzji inwestycyjnych pozwalają kontrolować ryzyko i maksymalizować zysk.



źródło: Bloomberg wyniki Superfund Blue za okres 29.06.2007-31.12.2016
wynik łączony do dnia 12.10.2016 wynik funduszu bazowego Superfund GMP Blue, następnie wynik Superfund SFIO Blue

◀ *Od początku istnienia Superfund Blue wypracowana stopa zwrotu wynosi 34,9%, co warte podkreślenia fundusz nawet w szczycie kryzysu w latach 2007-2008 radził sobie bardzo dobrze.*

Superfund Blue to unikalny produkt na polskim rynku. Automatyzacja procesu zarządzania oraz krótki horyzont inwestycyjny pozwalają maksymalizować stopę zwrotu, a wykorzystanie strategii long-short powoduje, że wyniki funduszu są niezależne od koniunktury na rynku akcji.

Wyniki Superfund Blue w 2016 roku

Sty	Lut	Mar	Kwi	Maj	Cze	Lip	Sie	Wrz	Paź	Lis	Gru	2016
0,13%	0,27%	1,17%	3,13%	0,43%	-2,03%	1,58%	-3,93%	3,09%	-3,26%	-0,98%	1,97%	1,29%

źródło: Bloomberg,
wynik łączony do dnia 12.10.2016 wynik funduszu bazowego Superfund GMP Blue, następnie wynik Superfund SFIO Blue

SUPERFUND TFI S.A.

Departament Zarządzania i Analiz