

**Niezbadany raport półroczny
na dzień 30 czerwca 2023 r.**

SUPERFUND SICAV

Société d'Investissement à Capital Variable
z wieloma subfunduszami
Luksemburg

R.C.S. Luksemburg B54921

Na podstawie niniejszych sprawozdań finansowych nie można otrzymać subskrypcji. Subskrypcje są ważne tylko wówczas, gdy dokonuje się ich na podstawie aktualnego prospektu uzupełnionego o ostatni raport roczny zawierający zbadane sprawozdania finansowe i ostatni niezbadany raport półroczny, jeśli został opublikowany później.

SUPERFUND SICAV

Spis treści

Organizacja.....	2
Łączne zestawienie aktywów netto	4
SUPERFUND SICAV - SUPERFUND GREEN	5
Zestawienie aktywów netto	5
Zestawienie inwestycji i pozostałych aktywów netto	6
Klasyfikacja inwestycji wg branży i terytorium	7
SUPERFUND SICAV - SUPERFUND RED.....	8
Zestawienie aktywów netto	8
Zestawienie inwestycji i pozostałych aktywów netto	9
Klasyfikacja inwestycji wg branży i terytorium	10
Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego.....	11
Informacja dodatkowa	21

SUPERFUND SICAV

Organizacja

Siedziba	2, Rue d'Alsace L-1122 LUKSEMBURG
Zarząd	Birgit HASLER Marc-Aurel Straße 10-12 1010 WIEDEN Nicolas Joachim Pierre MULLER 9, Rue Rudi Herber L-1749 HOWALD Jürgen GRAF 10-12, Marc-Aurel-Strasse A-1010 WIEDEN
Zarządzający alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi	FUCHS ASSET MANAGEMENT S.A. 49, Boulevard Prince Henri L-1724 LUKSEMBURG
Zarząd Zarządzającego alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi	Christophe PESSAULT Niezależny dyrektor 16, Rue Jean-Pierre Brasseur L-1258 LUKSEMBURG Jean-Jacques LAVA Zastępca Prezesa Zarządu - Dyrektor wspólnie zarządzający FUCHS ASSET MANAGEMENT S.A. 49, Boulevard Prince Henri L-1724 LUKSEMBURG Hervé COUSSEMENT Administrator FUCHS ASSET MANAGEMENT S.A. 49, Boulevard Prince Henri L-1724 LUKSEMBURG
Członkowie Komisji Wykonawczej Zarządzającego alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi	Timothé FUCHS, Prezes Zarządu - Dyrektor wspólnie zarządzający Jean-Jacques LAVA, Zastępca Prezesa Zarządu - Dyrektor wspólnie zarządzający Lucie FISCHBACH Dyrektor ds. zgodności z przepisami - Dyrektor wspólnie zarządzający Michael VERSCHUURE Dyrektor finansowy - Dyrektor wspólnie zarządzający
Zarządzający inwestycjami i subdystrybutor	FUCHS ASSET MANAGEMENT S.A. 49, Boulevard Prince Henri L-1724 LUKSEMBURG

SUPERFUND SICAV

Organizacja (cd.)

Depozytariusz i agent płatniczy

QUINTET PRIVATE BANK (EUROPE) S.A.
43, Boulevard Royal
L-2955 LUKSEMBURG

Agent lokalny, administracyjny i transferowy

UI efa S.A. (Uprzednio EUROPEAN FUND ADMINISTRATION S.A.)
2, Rue d'Alsace
L-1122 LUKSEMBURG

Niezależny biegły rewident

ERNST & YOUNG
Société Anonyme
35E, Avenue John F. Kennedy
L-1855 LUKSEMBURG

Doradca prawny

GSK STOCKMANN S.A.
44, Avenue John F. Kennedy
L-1855 LUKSEMBURG

Brokerzy

ADM INVESTOR SERVICES, Inc.
Chicago Board of Trade Building
141 W, Jackson Blvd. - Suite 1600A, CHICAGO
IL-60604-3190, Stany Zjednoczone

StoneX Financial Inc.
1251 NW, Briarcliff Parkway, Suite 800, KANSAS CITY
MO-64116, Stany Zjednoczone

SUPERFUND SICAV

Łączne zestawienie aktywów netto (w USD)

na dzień 30 czerwca 2023 r.

Aktywa

Inwestycje

Portfel papierów wartościowych według wartości rynkowej	22.932.782,07
	<hr/>
	22.932.782,07

Środki pieniężne i ich ekwiwalenty

Środki pieniężne w bankach	17.047.558,34
Pozostałe aktywa płynne	38.118.081,80
	<hr/>
	55.165.640,14

Należności

Niezrealizowany zysk na kontraktach typu futures	4.159.658,96
Niezrealizowany zysk na walutowych kontraktach terminowych typu forward	1.584.568,06
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	10.961,82
	<hr/>
	5.755.188,84

Aktywa ogółem

83.853.611,05

Zobowiązania

Zobowiązania

Pozostałe zobowiązania płynne	13.963.379,82
Zobowiązania z tytułu umorzenia akcji	147.324,92
Niezrealizowana strata na kontraktach typu futures	1.836.899,40
Niezrealizowana strata na walutowych kontraktach terminowych typu forward	911.549,41
Zobowiązania z tytułu kosztów	352.095,46
	<hr/>
	17.211.249,01

Pozostałe zobowiązania

Pozostałe zobowiązania	677.800,60
	<hr/>
	677.800,60

Pasywa ogółem

17.889.049,61

Aktywa netto ogółem na koniec okresu

65.964.561,44

SUPERFUND SICAV - SUPERFUND GREEN

Zestawienie aktywów netto (w USD)

na dzień 30 czerwca 2023 r.

Aktywa

Inwestycje

Portfel papierów wartościowych według wartości rynkowej	21.510.438,94
	<hr/>
	21.510.438,94

Środki pieniężne i ich ekwiwalenty

Środki pieniężne w bankach	16.181.870,64
Pozostałe aktywa płynne	30.793.963,39
	<hr/>
	46.975.834,03

Należności

Niezrealizowany zysk na kontraktach typu futures	4.151.005,97
Niezrealizowany zysk na walutowych kontraktach terminowych typu forward	1.584.568,06
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	10.366,70
	<hr/>
	5.745.940,73

Aktywa ogółem

74.232.213,70

Zobowiązania

Zobowiązania

Pozostałe zobowiązania płynne	8.123.075,11
Zobowiązania z tytułu umorzenia akcji	147.324,92
Niezrealizowana strata na kontraktach typu futures	1.811.854,44
Niezrealizowana strata na walutowych kontraktach terminowych typu forward	911.549,41
Zobowiązania z tytułu kosztów	318.455,07
	<hr/>
	11.312.258,95

Pozostałe zobowiązania

Pozostałe zobowiązania	677.800,60
	<hr/>
	677.800,60

Pasywa ogółem

11.990.059,55

Aktywa netto ogółem na koniec okresu

62.242.154,15

Podział aktywów netto według klasy akcji

Klasa akcji	Liczba akcji	Waluta danej klasy akcji	Wartość aktywów netto (NAV) na akcję w walucie danej klasy akcji	Aktywa netto na klasę akcji (w USD)
USD	15.670,67200	USD	751,17239	11.771.376,19
EUR	19.534,34900	EUR	662,21149	14.113.034,49
Gold	20.454,61500	USD	996,13785	20.375.616,20
Silver	15.717,50200	USD	845,49876	13.289.128,51
EUR II	1.298,04200	EUR	702,58408	994.974,15
Euro Gold II	1.963,70600	EUR	792,57937	1.698.024,61
				<hr/>
				62.242.154,15

Załączona informacja stanowi integralną część niniejszego sprawozdania finansowego.

SUPERFUND SICAV - SUPERFUND GREEN

Zestawienie inwestycji i pozostałych aktywów netto (w USD)

na dzień 30 czerwca 2023 r.

Waluta	Liczba / wartość nominalna	Opis	Koszt	Wartość rynkowa	% aktywów netto ogółem *
<u>Inwestycje w papiery wartościowe</u>					
<u>Otwarte fundusze inwestycyjne</u>					
Fundusze inwestycyjne (UCITS)					
EUR	3,49	Istl Cash Series Plc BlackRock ICS EUR Lqy Select Fd Dist	0,00	378,71	0,00
USD	7.253.493,2	Invesco Liquidity Fds Plc US Dollars Ptf USD Dist	7.214.456,16	7.253.493,20	11,66
USD	6.915.963,36	Istl Cash Series Plc BlackRock ICS USD Liquid Fd S USD Dist	6.899.944,59	6.915.963,36	11,11
USD	622.237,98	State Street Liquidity Plc LVNAV Fd I USD Cap	6.902.931,28	7.340.603,67	11,79
			<u>21.017.332,03</u>	<u>21.510.060,23</u>	<u>34,56</u>
Inwestycje w papiery wartościowe ogółem			21.017.332,03	21.510.438,94	34,56
Środki pieniężne w bankach				16.181.870,64	26,00
Pozostałe aktywa/(pasywa) netto				24.549.844,57	39,44
Ogółem				<u>62.242.154,15</u>	<u>100,00</u>

* Niewielkie różnice mogą wynikać z zaokrągleń przy obliczaniu wartości procentowych.

Załączona informacja stanowi integralną część niniejszego sprawozdania finansowego.

SUPERFUND SICAV - SUPERFUND GREEN

Klasyfikacja inwestycji wg branży i terytorium
na dzień 30 czerwca 2023 r.

Klasyfikacja według branży

(w procentach aktywów netto)

Fundusze inwestycyjne	34,56 %
Ogółem	<u>34,56 %</u>

Klasyfikacja według terytorium

(według siedziby emitenta)

(w procentach aktywów netto)

Irlandia	34,56 %
Ogółem	<u>34,56 %</u>

SUPERFUND SICAV - SUPERFUND RED

Zestawienie aktywów netto (w USD)

na dzień 30 czerwca 2023 r.

Aktywa

Inwestycje

Portfel papierów wartościowych według wartości rynkowej	1.422.343,13
	<hr/>
	1.422.343,13

Środki pieniężne i ich ekwiwalenty

Środki pieniężne w bankach	865.687,70
Pozostałe aktywa płynne	7.324.118,41
	<hr/>
	8.189.806,11

Należności

Niezrealizowany zysk na kontraktach typu futures	8.652,99
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	595,12
	<hr/>
	9.248,11

Aktywa ogółem

9.621.397,35

Zobowiązania

Zobowiązania

Pozostałe zobowiązania płynne	5.840.304,71
Niezrealizowana strata na kontraktach typu futures	25.044,96
Zobowiązania z tytułu kosztów	33.640,39
	<hr/>
	5.898.990,06

Pasywa ogółem

5.898.990,06

Aktywa netto ogółem na koniec okresu

3.722.407,29

Podział aktywów netto według klasy akcji

Klasa akcji	Liczba akcji	Waluta danej klasy akcji	Wartość aktywów netto (NAV) na akcję w walucie danej klasy akcji	Aktywa netto na klasę akcji (w USD)
USD	2.652,11200	USD	708,80425	1.879.828,26
EUR	206,01300	EUR	618,20730	138.948,39
Gold	976,87300	USD	692,57611	676.558,90
Silver	2.432,45500	USD	422,23669	1.027.071,74
				<hr/>
				3.722.407,29

SUPERFUND SICAV - SUPERFUND RED

Zestawienie inwestycji i pozostałych aktywów netto (w USD)

na dzień 30 czerwca 2023 r.

Waluta	Liczba / wartość nominalna	Opis	Koszt	Wartość rynkowa	% aktywów netto ogółem *
<u>Inwestycje w papiery wartościowe</u>					
<u>Otwarte fundusze inwestycyjne</u>					
Fundusze inwestycyjne (UCITS)					
USD	450.000	Invesco Liquidity Fds Plc US Dollars Pf USD Dist	450.000,00	450.000,00	12,09
USD	500.665,34	Istl Cash Series Plc BlackRock ICS USD Liquid Fd S USD Dist	500.071,20	500.665,34	13,45
USD	39.982,52	State Street Liquidity Plc LVNAV Fd I USD Cap	463.888,88	471.677,79	12,67
Inwestycje w papiery wartościowe ogółem			1.413.960,08	1.422.343,13	38,21
Środki pieniężne w bankach				865.687,70	23,26
Pozostałe aktywa/(pasywa) netto				1.434.376,46	38,53
Ogółem				3.722.407,29	100,00

* Niewielkie różnice mogą wynikać z zaokrągleń przy obliczaniu wartości procentowych.

Załączona informacja stanowi integralną część niniejszego sprawozdania finansowego.

SUPERFUND SICAV - SUPERFUND RED

Klasyfikacja inwestycji wg branży i terytorium

na dzień 30 czerwca 2023 r.

Klasyfikacja według branży

(w procentach aktywów netto)

Fundusze inwestycyjne	38,21 %
Ogółem	<u>38,21 %</u>

Klasyfikacja według terytorium

(według siedziby emitenta)

(w procentach aktywów netto)

Irlandia	38,21 %
Ogółem	<u>38,21 %</u>

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego

na dzień 30 czerwca 2023 r.

Nota 1 - Informacje ogólne

SUPERFUND SICAV („Spółka”) jest funduszem inwestycyjnym podlegającym Części II znowelizowanej Ustawy z dnia 17 grudnia 2010 r. o przedsiębiorstwach zbiorowego inwestowania i kwalifikuje się jako alternatywny fundusz inwestycyjny („AFI”) zgodnie z ustawą z dnia 12 lipca 2013 r. o zarządzających alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi („ZAFI”). Spółka została założona 20 maja 1996 r. jako Société Anonyme kwalifikująca się jako Société d'Investissement à Capital Variable.

W dniu 2 listopada 2021 r. Zarząd podjął decyzję o powołaniu spółki Fuchs Asset Management S.A. na nowego Zarządzającego alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi z dniem 1 stycznia 2022 r.

Spółka Superfund Asset Management GmbH działa jako wyłączny założyciel Spółki.

Wartość aktywów netto (NAV), ceny umorzenia, emisji i konwersji na akcję są dostępne w siedzibie Spółki oraz u Przedstawicieli w krajach, w których Spółka i/lub jej Subfundusze są dopuszczone do oferty publicznej. Statut Spółki, prospekt emisyjny, a także najnowsze raporty roczne i półroczne można uzyskać w normalnych godzinach pracy w siedzibie Spółki oraz w biurze dowolnego Przedstawiciela w krajach, w których Akcje są dopuszczone do oferty publicznej.

Nota 2 - Istotne zasady rachunkowości

a) Prezentacja sprawozdania finansowego

Sprawozdanie finansowe Spółki zostało sporządzone zgodnie z luksemburskimi wymogami prawnymi i regulacyjnymi dotyczącymi Przedsiębiorstw zbiorowego inwestowania oraz ogólnie przyjętymi zasadami rachunkowości w Luksemburgu.

Sprawozdanie finansowe Spółki zostało sporządzone przy założeniu kontynuacji działalności.

b) Wycena aktywów

- i. Wartość gotówki w kasie lub gotówki zdeponowanej, weksli i skryptów dłużnych oraz należności, rozliczeń międzyokresowych kosztów, dywidend pieniężnych i odsetek zadeklarowanych lub narosłych zgodnie z powyższym, lecz nie otrzymanych, uznaje się za ich pełną kwotę, o ile w dowolnym przypadku ich zapłata lub otrzymanie w całości jest nieprawdopodobne, w którym to przypadku ich wartość zostanie osiągnięta po wprowadzeniu obniżki, jaką Członkowie Zarządu mogą uznać za stosowną w takim przypadku w celu odzwierciedlenia ich faktycznej wartości;
 - ii. Papiery wartościowe zawarte w portfelu, które są notowane na oficjalnej giełdzie lub pozostające w obrocie na Rynku regulowanym wycenia się na podstawie ostatniej dostępnej ceny, po której są one dostępne w obrocie, przekazanej przez źródło wyceny zatwierdzone przez Członków Zarządu. Jeśli ceny nie są reprezentatywne w odniesieniu do ich faktycznej wartości rynkowej, takie papiery wartościowe oraz wszelkie papiery wartościowe zawarte w portfelu, które nie są notowane na giełdzie ani nie pozostają w obrocie, wycenia się na podstawie uzasadnionych, możliwych do przewidzenia cen sprzedaży określonych w sposób ostrożny pod kierownictwem Członków Zarządu;
 - iii. Jednostki lub akcje w przedsiębiorstwach zbiorowego inwestowania, w tym funduszach hedgingowych, wycenia się na podstawie ostatniej określonej i dostępnej wartości aktywów netto (oficjalnej wartości aktywów netto), lub jeśli cena ta nie jest reprezentatywna w odniesieniu do faktycznej wartości netto takich aktywów, wówczas Zarząd określa cenę w sposób rzetelny i sprawiedliwy. Jeśli oficjalna wartość aktywów netto jest niedostępna, wówczas inwestycje wycenia się na podstawie szacowanej wartości aktywów netto (tj. które nie są zazwyczaj stosowane do celów subskrypcji i umorzenia akcji) podanej przez odnośnego zarządcę jeśli jest ona nowsza od oficjalnej wartości aktywów netto pod warunkiem, że Członkowie Zarządu mają wystarczającą pewność, że metoda wyceny stosowana przez odnośnego zarządcę dla przedmiotowej szacowanej wartości aktywów netto jest spójna w porównaniu z oficjalną wartością. W przypadku wystąpienia zdarzeń, które skutkowały istotną zmianą szacowanej wartości aktywów netto od dnia ostatniego raportu, wartość takich inwestycji dostosowuje się tak, aby zgodnie z uzasadnioną opinią Zarządu odzwierciedlała ona taką zmianę;
 - iv. Wartość upłynniająca opcji i kontraktów terminowych typu forward niebędących przedmiotem obrotu na giełdach lub innych Rynkach regulowanych oznacza, że ich wartość upłynniająca netto określona, zgodnie z politykami ustanowionymi przez Zarząd, na podstawie konsekwentnie stosowanej dla każdego innego rodzaju kontraktów. Wartość upłynniająca kontraktów terminowych typu futures, forward lub opcji niebędących przedmiotem obrotu na giełdach lub innych Rynkach regulowanych określa się na podstawie ostatnich dostępnych cen rozliczeniowych tych kontraktów na odnośnej giełdzie lub Rynku regulowanym, na którym dany kontrakt pozostaje w obrocie, pod warunkiem, że jeśli kontrakt terminowy typu futures, forward lub opcji nie może zostać upłynniony w odnośnym Dniu wyceny, podstawą określenia wartości upłynniającej takiego kontraktu jest wartość, którą Zarząd uzna za rzetelną i uzasadnioną.
 - v. Wszystkie pozostałe papiery wartościowe i inne aktywa wycenia się według ich godziwej wartości rynkowej ustalonej z zachowaniem ostrożności i w dobrej wierze zgodnie z procedurami ustanowionymi przez Zarząd.
- c) Zrealizowany zysk/(strata) na portfelu papierów wartościowych

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego (cd.)

na dzień 30 czerwca 2023 r.

Zrealizowane zyski i straty na portfelu papierów wartościowych oblicza się na podstawie średniego kosztu nabycia.

d) Dochód z portfela inwestycyjnego

Dochód z dywidend jest rejestrowany w pierwszym dniu notowania akcji bez prawa do dywidendy, po potrąceniu podatku u źródła.

e) Wycena walutowych kontraktów terminowych typu forward

Otwarte walutowe kontrakty terminowe typu forward wycenia się według stawek rynku terminowego typu forward na pozostały okres od daty wyceny do terminu zapadalności kontraktów. Niezrealizowane zyski i straty na otwartych kontraktach wykazuje się w zestawieniu aktywów netto.

f) Wycena kontraktów typu futures

Otwarte kontrakty typu futures wycenia się po ostatnim kursie rozliczeniowym lub kursie zamknięcia na giełdach papierów wartościowych lub rynkach regulowanych. Niezrealizowane zyski i straty na otwartych kontraktach wykazuje się w zestawieniu aktywów netto.

g) Przeliczanie walut obcych

Środki pieniężne w bankach, pozostałe aktywa netto, zobowiązania oraz wartość rynkową papierów wartościowych w portfelu wyrażoną w walutach innych niż waluta referencyjna Subfunduszu przelicza się na tę walutę po kursie wymiany obowiązującym w dniu sporządzenia sprawozdania finansowego. Przychody i koszty wyrażone w walutach innych niż waluta referencyjna Subfunduszu przelicza się na tę walutę po kursie obowiązującym w dniu transakcji.

Na dzień sporządzenia sprawozdania finansowego zastosowano następujące kursy wymiany walut:

1	USD	=	1,5021782	AUD	Dolar australijski
			4,8217500	BRL	Real brazylijski
			1,3233000	CAD	Dolar kanadyjski
			0,8944000	CHF	Frank szwajcarski
			802,1401098	CLP	Peso chilijskie
			7,2745000	CNH	Juan chiński za granicą
			4.173,6227045	COP	Peso kolumbijskie
			0,9165903	EUR	Euro
			0,7865345	GBP	Funt szterling
			7,8365500	HKD	Dolar hongkoński
			15.031,9428786	IDR	Rupia indonezyjska
			82,0565000	INR	Rupia indyjska
			144,5149983	JPY	Jen japoński
			1.317,5143774	KRW	Won południowokoreański
			4,6675000	MYR	Ringgit malezyjski
			1,6323865	NZD	Dolar nowozelandzki
			3,6274500	PEN	Nowy sol peruwiański
			55,3080000	PHP	Peso filipińskie
			10,8058000	SEK	Korona szwedzka
			1,3535500	SGD	Dolar singapurski
			35,3199997	THB	Bat tajlandzki
			31,1689996	TWD	Nowy dolar tajwański
			18,8920001	ZAR	Rand południowoafrykański

h) Łączne sprawozdanie finansowe

Łączne sprawozdanie finansowe Spółki wyrażone jest w USD i jest równe sumie odnośnych pozycji w sprawozdaniu finansowym każdego Subfunduszu.

i) Pozostałe aktywa płynne / Pozostałe zobowiązania płynne

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego (cd.)

na dzień 30 czerwca 2023 r.

Pozycje „Pozostałe aktywa płynne” i „Pozostałe zobowiązania płynne” składają się głównie z rachunków pieniężnych prowadzonych przez brokerów, depozytów / limitów w rachunku bieżącym, w tym kwot zabezpieczenia zobowiązań wynikających z kontraktów terminowych typu futures i forward.

Nota 3 - Opłaty za zarządzanie

Jako wynagrodzenie za swoje usługi, Zarządzający inwestycjami otrzymuje opłatę za zarządzanie w wysokości 4,8% rocznie (lub 2% rocznie w przypadku Superfund Green EUR I i USD I oraz 3% w przypadku Superfund Green Gold I i Silver I) od średniej wartości aktywów netto w danym okresie i płatną co miesiąc z aktywów odnośnego Subfunduszu lub Klasy.

ZAFI otrzymuje za swoje usługi opłatę w wysokości 0,04% rocznie od średniej wartości aktywów netto w danym okresie, płatną co kwartał, przy czym roczne minimum wynosi 40.000 USD w przypadku Subfunduszu SUPERFUND GREEN i 11.500 USD w przypadku Subfunduszu SUPERFUND RED.

Nota 5 - Premia motywacyjna

Subfundusze płacą Zarządzającemu inwestycjami premię motywacyjną równą procentowi wzrostu Wartości Aktywów Netto (NAV) danej Klasy Akcji, od której naliczana jest Premia motywacyjna na każdy Dzień NAV powyżej Kwoty wartości referencyjnej (tzw. High Watermark) (zgodnie z definicją poniżej). Premia motywacyjna będzie obliczana i rozliczana w każdym Dniu NAV (na podstawie liczby Akcji wyemitowanych w tym Dniu NAV) po uiszczeniu lub naliczeniu wszystkich innych opłat i kosztów. Premia motywacyjna jest płatna co miesiąc.

W przypadku Subfunduszu SUPERFUND SICAV - SUPERFUND GREEN premia motywacyjna w wysokości 20% (lub 25% w przypadku Subfunduszu SUPERFUND SICAV - SUPERFUND GREEN - klasy EUR I, Gold I, Silver I i USD I), w przypadku Subfunduszu SUPERFUND SICAV - SUPERFUND RED premia motywacyjna w wysokości 25% jest należna dla wszystkich klas po przekroczeniu kwoty High Watermark w klasie USD (referencyjna klasa akcji). High Watermark to większa z następujących wartości: (i) najwyższa Wartość Aktywów Netto Klasy USD w dowolnym poprzednim Dniu NAV, w którym Premia motywacyjna skryształizowała się (po odliczeniu wszelkich takich Premii motywacyjnych); lub (ii) kwota 1 000,00 USD.

Metoda obliczania premii motywacyjnej jest następująca: Po pierwsze, procent od NAV Klasy USD, który stanowi premia motywacyjna (wpływ premii motywacyjnej) należy obliczyć, stosując następujący wzór:

$$\frac{((NAV - High\ Watermark) * 20)}{High\ Watermark} = \text{Wpływ premii motywacyjnej w \%}$$
 lub odpowiednio
$$\frac{((NAV - High\ Watermark) * 25)}{High\ Watermark} = \text{Wpływ premii motywacyjnej w \%}$$

Ten procentowy wpływ premii motywacyjnej zostanie następnie zastosowany do wszystkich klas akcji w celu obliczenia kwoty premii motywacyjnej dla każdej klasy akcji.

W odniesieniu do Klas EUR II i Euro Gold II, High Watermark to większa z następujących wartości: (i) najwyższa Wartość Aktywów Netto Klasy USD w dowolnym poprzednim Dniu NAV, w którym Premia motywacyjna skryształizowała się (po odliczeniu wszelkich takich Premii motywacyjnych); lub (ii) kwota 1 781,57 USD w Klasie USD.

Na dzień sporządzenia sprawozdania finansowego nie ujęto żadnych premii motywacyjnych.

Nota 6 - Podatek od subskrypcji („taxe d'abonnement”)

Spółka podlega prawu luksemburskiemu.

Zgodnie z obowiązującym ustawodawstwem i przepisami Spółka podlega rocznemu podatkowi od subskrypcji „taxe d'abonnement” w wysokości 0,05%, który jest płatny co kwartał i obliczany na podstawie aktywów netto każdego Subfunduszu w ostatnim dniu każdego kwartału, z wyjątkiem Subfunduszy lub Klas Akcji zarezerwowanych dla Inwestorów Instytucjonalnych, dla których zastosowanie ma obniżona stawka podatku w wysokości 0,01%.

Zgodnie z art. 175 (a) zmienionej ustawy z dnia 17 grudnia 2010 r., aktywa netto zainwestowane w przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania już podlegające „taxe d'abonnement” są zwolnione z tego podatku.

Nota 7 - Walutowe kontrakty terminowe typu forward

Na dzień sporządzenia sprawozdania finansowego następujący Subfundusz jest zaangażowany w następujące walutowe kontrakty terminowe typu forward:

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego (cd.)

na dzień 30 czerwca 2023 r.

SUPERFUND SICAV - SUPERFUND GREEN

Waluta	Kupno	Waluta	Sprzedaż	Termin zapadalności	Niezrealizowany wynik (w USD)
Terminowe kontrakty walutowe typu forward (Fcstone LLC, Stany Zjednoczone Ameryki)					
BRL	6.000.000,00	USD	1.167.633,21	20.09.2023	66.566,46
BRL	1.500.000,00	USD	299.341,45	20.09.2023	9.208,47
CLP	900.000.000,00	USD	1.089.588,38	20.09.2023	23.928,48
CNH	600.000,00	USD	83.752,09	20.09.2023	-647,85
CNH	6.000.000,00	USD	831.658,47	20.09.2023	-616,09
COP	7.800.000.000,00	USD	1.714.662,56	20.09.2023	114.419,68
INR	150.000.000,00	USD	1.823.929,96	20.09.2023	-1.215,27
INR	270.000.000,00	USD	3.288.672,35	20.09.2023	-7.785,91
INR	140.000.000,00	USD	1.705.237,52	20.09.2023	-4.037,14
INR	140.000.000,00	USD	1.705.237,52	20.09.2023	-4.037,14
INR	150.000.000,00	USD	1.821.714,84	20.09.2023	999,85
INR	270.000.000,00	USD	3.288.271,83	20.09.2023	-7.385,39
KRW	700.000.000,00	USD	543.465,60	20.09.2023	-9.128,98
KRW	600.000.000,00	USD	462.566,78	20.09.2023	-4.563,96
KRW	1.000.000.000,00	USD	778.543,35	20.09.2023	-15.205,32
KRW	1.000.000.000,00	USD	780.694,97	20.09.2023	-17.356,94
PEN	12.800.000,00	USD	3.456.283,42	20.09.2023	57.159,62
PHP	216.000.000,00	USD	3.880.007,19	20.09.2023	32.878,31
PHP	222.000.000,00	USD	4.019.554,59	20.09.2023	2.022,18
USD	4.678.528,39	CNH	33.000.000,00	20.09.2023	107.795,29
USD	1.742.323,72	IDR	26.000.000.000,00	20.09.2023	14.668,61
USD	10.136.358,15	INR	840.000.000,00	20.09.2023	-70.844,11
USD	2.514.668,90	KRW	3.300.000.000,00	20.09.2023	-4.346,61
USD	912.637,75	KRW	1.200.000.000,00	20.09.2023	-3.367,89
USD	917.283,92	KRW	1.200.000.000,00	20.09.2023	1.278,28
USD	1.202.284,34	PEN	4.400.000,00	20.09.2023	-5.461,70
USD	4.355.524,08	PHP	246.000.000,00	20.09.2023	-100.817,74
USD	2.555.168,41	THB	88.000.000,00	20.09.2023	57.440,14
USD	4.530.829,34	TWD	138.000.000,00	20.09.2023	85.955,44
					317.502,77
Terminowe kontrakty walutowe typu forward (ADM Investor Services Inc, Stany Zjednoczone Ameryki)					
AUD	600.000,00	CAD	542.374,20	20.09.2023	-10.058,28
AUD	1.700.000,00	CAD	1.540.200,00	20.09.2023	-31.123,05
AUD	600.000,00	CAD	544.050,00	20.09.2023	-11.324,66
AUD	1.700.000,00	CAD	1.541.475,00	20.09.2023	-32.086,55
AUD	1.400.000,00	CAD	1.274.994,00	20.09.2023	-30.613,75
AUD	3.200.000,00	JPY	286.579.200,00	20.09.2023	126.191,19
AUD	2.000.000,00	NZD	2.186.328,40	20.09.2023	-4.604,37
AUD	800.000,00	NZD	870.792,00	20.09.2023	448,98
AUD	2.000.000,00	NZD	2.198.700,00	20.09.2023	-12.183,21
AUD	700.000,00	USD	478.240,00	20.09.2023	-11.238,50
AUD	300.000,00	USD	201.959,40	20.09.2023	-1.815,90
AUD	300.000,00	USD	202.710,00	20.09.2023	-2.566,50
AUD	600.000,00	USD	408.300,00	20.09.2023	-8.013,00
AUD	1.900.000,00	USD	1.240.263,00	20.09.2023	27.312,50
CAD	613.116,00	AUD	700.000,00	20.09.2023	-3.117,52
CAD	1.315.425,00	AUD	1.500.000,00	20.09.2023	-5.467,53
CAD	3.533.636,00	AUD	4.000.000,00	20.09.2023	4.943,85
CAD	1.508.393,00	AUD	1.700.000,00	20.09.2023	7.086,93
CAD	527.370,00	AUD	600.000,00	20.09.2023	-1.280,19
CAD	1.511.630,48	AUD	1.700.000,00	20.09.2023	9.533,45
CAD	666.460,00	GBP	400.000,00	20.09.2023	-4.419,74
CAD	667.400,00	GBP	400.000,00	20.09.2023	-3.709,39
CAD	667.920,00	GBP	400.000,00	20.09.2023	-3.316,44
CAD	2.700.000,00	JPY	273.605.040,00	20.09.2023	125.015,79
CAD	500.000,00	USD	374.419,65	20.09.2023	3.877,62
CAD	500.000,00	USD	374.111,49	20.09.2023	4.185,78
CHF	3.900.000,00	EUR	4.031.216,08	20.09.2023	-18.819,82
CHF	1.900.000,00	JPY	289.496.730,00	20.09.2023	112.819,80
CHF	1.600.000,00	USD	1.778.331,04	20.09.2023	25.264,94
CZK	9.000.000,00	USD	413.280,07	20.09.2023	-1.345,15
CZK	21.000.000,00	USD	959.267,67	20.09.2023	1.913,81
CZK	21.000.000,00	USD	960.114,12	20.09.2023	1.067,36
CZK	9.000.000,00	USD	413.033,50	20.09.2023	-1.098,58
DKK	3.600.000,00	USD	531.475,14	20.09.2023	-1.459,95
DKK	8.400.000,00	USD	1.235.239,62	20.09.2023	1.462,48
DKK	3.000.000,00	USD	444.312,80	20.09.2023	-2.633,48

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego (cd.)

na dzień 30 czerwca 2023 r.

Waluta	Kupno	Waluta	Sprzedaż	Termin zapadalności	Niezrealizowany wynik (w USD)
DKK	3.600.000,00	USD	533.175,36	20.09.2023	-3.160,17
DKK	8.400.000,00	USD	1.233.661,33	20.09.2023	3.040,77
EUR	510.620,92	CHF	500.000,00	20.09.2023	-4.353,21
EUR	1.542.575,07	CHF	1.500.000,00	20.09.2023	-1.372,49
EUR	1.541.592,16	CHF	1.500.000,00	20.09.2023	-2.444,84
EUR	1.200.000,00	GBP	1.042.668,00	20.09.2023	-11.629,55
EUR	2.000.000,00	JPY	294.876.000,00	20.09.2023	123.729,21
EUR	706.179,07	NOK	8.400.000,00	20.09.2023	-12.757,44
EUR	3.305.073,80	SEK	38.400.000,00	20.09.2023	52.850,45
EUR	500.000,00	USD	551.100,00	20.09.2023	-3.479,23
EUR	500.000,00	USD	551.000,00	20.09.2023	-3.379,23
EUR	500.000,00	USD	549.310,00	20.09.2023	-1.689,23
EUR	1.100.000,00	USD	1.204.027,00	20.09.2023	738,69
EUR	1.100.000,00	USD	1.202.410,00	20.09.2023	2.355,69
GBP	400.000,00	CAD	677.000,00	20.09.2023	-3.545,20
GBP	400.000,00	CAD	678.560,00	20.09.2023	-4.724,07
GBP	2.000.000,00	CAD	3.374.820,00	20.09.2023	-10.033,09
GBP	972.272,55	CHF	1.100.000,00	20.09.2023	-3.569,00
GBP	973.279,07	CHF	1.100.000,00	20.09.2023	-2.289,31
GBP	1.035.192,00	EUR	1.200.000,00	20.09.2023	2.124,56
GBP	1.207.724,00	EUR	1.400.000,00	20.09.2023	2.478,65
GBP	1.600.000,00	JPY	273.348.800,00	20.09.2023	118.742,75
GBP	600.000,00	USD	760.500,00	20.09.2023	2.497,52
GBP	300.000,00	USD	380.250,00	20.09.2023	1.248,76
GBP	600.000,00	USD	755.880,00	20.09.2023	7.117,52
GBP	300.000,00	USD	377.940,00	20.09.2023	3.558,76
GBP	300.000,00	USD	377.328,00	20.09.2023	4.170,76
GBP	300.000,00	USD	377.940,00	20.09.2023	3.558,76
HUF	200.000.000,00	USD	561.403,52	20.09.2023	12.356,52
ILS	1.000.000,00	USD	276.510,44	20.09.2023	-6.089,00
ILS	500.000,00	USD	137.684,15	20.09.2023	-2.473,43
JPY	53.841.600,00	GBP	300.000,00	20.09.2023	-4.351,24
NOK	6.000.000,00	USD	570.667,68	20.09.2023	-9.065,18
NOK	6.000.000,00	USD	574.055,56	20.09.2023	-12.453,06
NOK	2.400.000,00	USD	225.776,11	20.09.2023	-1.135,11
NOK	3.000.000,00	USD	282.220,13	20.09.2023	-1.418,88
NZD	5.211.408,00	AUD	4.800.000,00	20.09.2023	-10.868,43
NZD	500.000,00	USD	311.360,00	20.09.2023	-5.163,35
NZD	500.000,00	USD	311.890,00	20.09.2023	-5.693,35
PLN	8.000.000,00	USD	1.877.713,88	20.09.2023	83.473,54
PLN	1.200.000,00	USD	281.657,08	20.09.2023	12.521,03
SEK	600.000,00	EUR	50.828,50	20.09.2023	61,50
SEK	600.000,00	USD	55.220,65	20.09.2023	510,57
USD	1.240.263,00	AUD	1.900.000,00	20.09.2023	-27.312,50
USD	1.240.453,00	AUD	1.900.000,00	20.09.2023	-27.122,50
USD	738.585,17	CAD	1.000.000,00	20.09.2023	-18.009,36
USD	1.039.335,98	DKK	7.200.000,00	20.09.2023	-20.694,39
USD	1.075.249,00	EUR	1.000.000,00	20.09.2023	-19.992,53
USD	747.456,00	GBP	600.000,00	20.09.2023	-15.541,52
USD	127.903,00	GBP	100.000,00	20.09.2023	736,75
USD	402.252,61	ILS	1.500.000,00	20.09.2023	-3.379,55
USD	269.978,40	ILS	1.000.000,00	20.09.2023	-443,04
USD	269.687,16	ILS	1.000.000,00	20.09.2023	-734,28
USD	3.062.854,16	JPY	420.000.000,00	20.09.2023	121.250,01
USD	1.572.099,75	NOK	17.400.000,00	20.09.2023	-56.547,50
USD	1.683.416,00	NZD	2.800.000,00	20.09.2023	-31.285,24
USD	366.030,00	NZD	600.000,00	20.09.2023	-1.405,98
USD	2.332.685,37	SEK	25.200.000,00	20.09.2023	-8.025,89
USD	1.424.857,51	ZAR	28.500.000,00	20.09.2023	-71.908,88

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego (cd.)

na dzień 30 czerwca 2023 r.

Waluta	Kupno	Waluta	Sprzedaż	Termin zapadalności	Niezrealizowany wynik (w USD)
ZAR	5.000.000,00	USD	262.606,42	20.09.2023	-15,83
ZAR	9.500.000,00	USD	511.495,18	20.09.2023	-12.573,05
ZAR	9.500.000,00	USD	507.641,34	20.09.2023	-8.719,21
ZAR	4.500.000,00	USD	237.919,00	20.09.2023	-1.587,47
					355.515,88

Nota 8 - Kontrakty typu futures

Na dzień sporządzenia sprawozdania finansowego następujące Subfundusze są zaangażowane w następujące kontrakty typu futures:

SUPERFUND SICAV - SUPERFUND GREEN

	Liczba kontraktów	Oznaczenie	Waluta	Ekspozycja (w USD)	Niezrealizowany wynik (w USD)
Sprzedaż	27	Australian 90 Day Bank Bill FUT 09/23 SFE	AUD	-17.773.184,74	35.058,13
Sprzedaż	47	Australian 90 Day Bank Bill FUT 12/23 SFE	AUD	-30.927.949,61	67.494,81
Sprzedaż	65	Australian T-Bonds 10 Year FUT 09/23 SFE	AUD	-5.026.833,94	40.168,81
Sprzedaż	201	Australian T-Bonds 3 Year FUT 09/23 SFE	AUD	-14.133.948,28	72.325,64
Kupno	10	S&P/ASX 200 Index FUT 09/23 SFE	AUD	1.191.769,43	-14 745,26
Sprzedaż	7	Bank Accept FUT 03/24 MSE	CAD	-1.250.576,21	-1 152,42
Sprzedaż	20	Bank Accept FUT 12/23 MSE	CAD	-3.569.296,45	9.842,82
Sprzedaż	37	Canada Govt Bond 6% 10 Year FUT 09/23 MSE	CAD	-3.425.988,06	-21 680,65
Kupno	70	Canola FUT 11/23 WCE	CAD	779.082,60	35.698,63
Kupno	10	S&P TSX 60 Index FUT 09/23 MSE	CAD	1.841.759,24	-1 481,15
Sprzedaż	23	SIX Swiss Exchange SARON Swiss Average Rate Overnight FUT 12/23 ICE	CHF	-6.299.348,73	-8 315,63
Kupno	7	CAC 40 Index FUT 07/23 MONEP	EUR	565.939,89	10.850,00
Sprzedaż	10	DAX Germany Index FUT 09/23 EUX	EUR	-4.438.188,00	-83 358,98
Sprzedaż	32	EURIBOR 3 Months BASE 365 FUT 03/24 ICE	EUR	-8.382.371,20	21.288,14
Sprzedaż	28	EURIBOR 3 Months BASE 365 FUT 06/24 ICE	EUR	-7.344.884,75	23.742,89
Sprzedaż	28	EURIBOR 3 Months BASE 365 FUT 09/24 ICE	EUR	-7.359.013,20	37.203,10
Sprzedaż	44	EURIBOR 3 Months BASE 365 FUT 12/23 ICE	EUR	-11.522.160,10	18.206,06
Kupno	5	Emission C02 Carbon Dioxide FUT 12/23 ICE	EUR	485.931,40	-16 910,50
Kupno	30	Euro BTP 10 Years FUT 09/23 EUX	EUR	3.800.280,30	-7 184,51
Kupno	3	Euro BUXL 30 Years FUT 09/23 EUX	EUR	456.910,80	768,35
Kupno	30	Euro Bund 10 Years FUT 09/23 EUX	EUR	4.377.310,20	-17 583,10
Kupno	15	Euro Stoxx 50 EUR (Price) Index FUT 09/23 EUX	EUR	724.478,55	6.756,41
Sprzedaż	179	Euro Stoxx 50 Volatility VSTOXX Index FUT 07/23 EUX	EUR	-290.980,61	27.873,04
Kupno	103	Euro Stoxx Banks EUR Price Index FUT 09/23 EUX	EUR	607.657,00	20.138,22
Sprzedaż	168	Euro-BOBL 5 Years FUT 09/23 EUX	EUR	-21.208.254,48	-2 024,57

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego (cd.)

na dzień 30 czerwca 2023 r.

	Liczba kontraktów	Oznaczenie	Waluta	Ekspozycja (w USD)	Niezrealizowany zysk (w USD)
Sprzedaż	488	Euro-Schatz 6% 2 Years FUT 09/23 EUX	EUR	-55.822.978,80	122.066,56
Kupno	3	FTSE MIB Index FUT 09/23 MIL	EUR	464.160,50	1.467,40
Kupno	44	French OAT FUT 09/23 EUX	EUR	6.163.713,60	8.815,07
Kupno	11	IBEX 35 Index FUT 07/23 MEFF	EUR	1.146.095,50	16.905,05
Kupno	4	Maize FUT 08/23 MATIF	EUR	50.295,10	-1 281,93
Kupno	39	Rapeseed FUT 08/23 MATIF	EUR	956.820,64	34.052,84
Kupno	78	Wheat Milling FUT 09/23 MATIF	EUR	981.818,18	-20 128,95
Sprzedaż	14	BBG Calc SONIA Coup 3M Tenor ISDA Fallback Rates FUT 03/24 ICE	GBP	-4.172.671,23	60.629,89
Sprzedaż	12	BBG Calc SONIA Coup 3M Tenor ISDA Fallback Rates FUT 06/24 ICE	GBP	-3.581.343,09	14.223,79
Sprzedaż	36	BBG Calc SONIA Coup 3M Tenor ISDA Fallback Rates FUT 09/23 ICE	GBP	-10.761.765,30	81.894,05
Sprzedaż	19	BBG Calc SONIA Coup 3M Tenor ISDA Fallback Rates FUT 12/23 ICE	GBP	-5.662.609,00	62.695,91
Kupno	26	Cocoa FUT 09/23 ICE	GBP	863.763,73	38.637,85
Sprzedaż	42	EUR FUT 09/23 CME	GBP	-5.757.058,13	-27 780,09
Kupno	11	FTSE 100 Index FUT 09/23 ICE	GBP	1.054.708,94	4.087,55
Sprzedaż	43	Long Gilt Fut 10 Years FUT 09/23 ICE	GBP	-5.210.070,06	-28 797,21
Sprzedaż	17	Hang Seng China Enterprises Index FUT 07/23 HKFE	HKD	-689.085,12	-1 843,92
Kupno	26	Hang Seng Index FUT 07/23 HKFE	HKD	3.119.880,56	-5 550,91
Kupno	13	Brent Crude Oil Dub Oman FUT 11/23 TCM	JPY	292.267,24	3.639,76
Kupno	31	EUR FUT 09/23 CME	JPY	4.188.051,46	171.084,98
Kupno	18	Gold - Ounce FUT 02/24 OSE	JPY	1.102.432,29	41.234,47
Kupno	33	Gold - Ounce FUT 04/24 OSE	JPY	2.021.125,86	22.046,15
Kupno	37	Japan Govt Bond 6% 10 Year FUT 09/23 OSE	JPY	38.033.076,61	128.429,58
Kupno	7	Nikkei 225 Index FUT 09/23 CME	JPY	809.760,24	34.055,72
Kupno	119	Nikkei 225 Index FUT 09/23 OSE	JPY	2.731.363,56	101.290,52
Kupno	3	Nikkei 225 Index FUT 09/23 SGX	JPY	344.341,42	11.860,36
Kupno	33	Platinum FUT 04/24 OSE	JPY	474.054,60	-36 234,99
Sprzedaż	46	Rubber FUT 11/23 OSE	JPY	-324.672,18	7.583,99
Kupno	40	TOPIX Index (TOKYO) FUT 09/23 OSE	JPY	6.332.906,69	223.644,61
Kupno	51	KOREA KOSPI 200 FUT 09/23 KSE	KRW	3.295.125,33	-57 760,28
Kupno	100	Korea 10 Years FUT 09/23 KFE	KRW	8.421.919,48	-23 384,94
Sprzedaż	617	Korea 3 Years FUT 09/23 KFE	KRW	-48.577.390,20	132.150,36
Sprzedaż	130	FTSE Bursa Malaysia KLCI Index FUT 07/23 MDE	MYR	-1.915.532,94	16.143,55
Kupno	8	Palm oil 1 Ton (1000 Kg) Crude FUT 09/23 MDE	MYR	162.356,72	-567,76
Kupno	72	OMX Stockholm 30 Index FUT 07/23 OMX	SEK	1.543.337,84	-1 230,82
Sprzedaż	13	30 Day Fed Fd FUT 08/23 CBOT	USD	-5.131.077,12	6.982,05

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego (cd.)

na dzień 30 czerwca 2023 r.

	Liczba kontraktów	Oznaczenie	Waluta	Ekspozycja (w USD)	Niezrealizowany zysk (w USD)
Sprzedaż	24	30 Day Fed Fd FUT 10/23 CBOT	USD	-9.466.757,28	28.767,90
Sprzedaż	18	30 Day Fed Fd FUT 11/23 CBOT	USD	-7.094.817,54	20.126,58
Kupno	13	AUD FUT 09/23 CME	USD	868.140,00	-23 191,00
Sprzedaż	69	Aluminum Primary FUT 09/23 LME	USD	-3.704.437,50	191.562,50
Sprzedaż	16	Brent Crude FUT 09/23 ICE	USD	-1.206.560,00	-16 050,00
Sprzedaż	34	Brent Crude FUT 09/23 NYM	USD	-2.563.940,00	-34 727,93
Sprzedaż	1	Brent Crude FUT 10/23 ICE	USD	-75.300,00	-940,00
Kupno	11	CAD FUT 09/23 CME	USD	831.930,00	-1 134,10
Sprzedaż	20	CBOE SPX Volatility Index FUT 07/23 CBF	USD	-300.220,00	25.530,00
Kupno	15	CHF FUT 09/23 CME	USD	2.111.906,25	13.985,63
Kupno	19	Cattle Feeder FUT 08/23 CME	USD	2.351.962,50	73.121,55
Sprzedaż	57	Cocoa FUT 09/23 FXN	USD	-1.911.210,00	-76 150,00
Sprzedaż	17	Coffee 'C' FUT 09/23 FXN	USD	-1.013.625,00	65.868,75
Kupno	16	Coffee Robusta FUT 09/23 ICE	USD	398.560,00	-44 430,00
Sprzedaż	4	Copper FUT 09/23 COMEX	USD	-375.950,00	-3 526,53
Kupno	2	Copper FUT 09/23 LME	USD	415.850,00	-268 637,50
Kupno	8	Corn FUT 12/23 CBOT	USD	197.900,00	-30 009,13
Sprzedaż	104	Cotton FUT 12/23 FXN	USD	-4.179.240,00	-48 625,00
Kupno	23	DJ Industrial Average Index FUT 09/23 CBOT	USD	3.983.945,00	9.676,43
Kupno	43	DOLLAR NEO-ZELANDIAIS FUT 09/23 CME	USD	2.638.695,00	-25 085,40
Kupno	65	EUR FUT 09/23 CME	USD	8.899.312,50	-24 577,88
Kupno	102	EUR FUT 09/23 CME	USD	13.965.075,00	103.162,50
Kupno	7	EUR FUT 09/23 CME	USD	958.387,50	7.236,25
Kupno	3	FC Orange Juice-A FUT 09/23 FXN	USD	114.637,50	-1 537,50
Kupno	86	FST Taiwan RIX Capped Price Return TWD Index FUT 07/23 SGX	USD	4.969.080,00	-9 910,00
Sprzedaż	49	FTSE XINHUA CHINA A 50 Index FUT 07/23 SGX	USD	-604.807,00	-4 595,00
Kupno	85	GBP FUT 09/23 CME	USD	6.746.343,75	21.399,25
Kupno	12	Gas Oil FUT 07/23 ICE	USD	851.100,00	-4 900,00
Sprzedaż	10	Gas Oil FUT 08/23 ICE	USD	-702.500,00	-8 975,00
Kupno	11	Gasoline FUT 08/23 NYM	USD	1.175.743,80	15.112,10
Kupno	2	Gasoline FUT 09/23 NYM	USD	206.850,00	3.183,60
Sprzedaż	19	Gold - Ounce FUT 08/23 COMEX	USD	-3.665.860,00	64.790,98
Kupno	105	Gold - Ounce FUT 08/23 COMEX	USD	20.258.700,00	-493 111,47
Kupno	9	Gold - Ounce FUT 08/23 COMEX	USD	1.736.460,00	-43 014,84
Sprzedaż	135	JPY FUT 09/23 CME	USD	-11.833.593,75	374.314,75
Kupno	13	Lead FUT 09/23 LME	USD	683.312,50	-31 837,50
Kupno	7	Lean Hogs FUT 08/23 CME	USD	259.280,00	9.359,92
Kupno	20	Live Cattle FUT 08/23 CME	USD	1.417.400,00	23.633,00
Kupno	33	Live Cattle FUT 10/23 CME	USD	2.370.060,00	103.177,76
Sprzedaż	314	MXN FUT 09/23 CME	USD	-9.024.360,00	-48 517,50
Sprzedaż	14	NY Harbor ULSD FUT 08/23 NYM	USD	-1.439.188,80	-9 544,21
Kupno	10	NY Harbor ULSD FUT 09/23 NYM	USD	1.025.640,00	6.937,14
Kupno	13	Nasdaq 100 Stock Index FUT 09/23 CME	USD	3.987.620,00	140.032,43
Kupno	11	Natural Gas FUT 08/23 NYM	USD	307.780,00	-2 815,03
Kupno	5	Natural Gas FUT 09/23 NYM	USD	138.700,00	6.540,00
Kupno	3	Natural Gas FUT 10/23 NYM	USD	85.410,00	8.190,00

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego (cd.)

na dzień 30 czerwca 2023 r.

	Liczba kontraktów	Oznaczenie	Waluta	Ekspozycja (w USD)	Niezrealizowany zysk (w USD)
Kupno	5	Natural Gas FUT 11/23 NYM	USD	160.550,00	-1 837,50
Kupno	0	Nickel FUT 09/23 LME	USD	0,00	120,00
Sprzedaż	1	Oats FUT 12/23 CBT	USD	-20.400,00	625,00
Sprzedaż	3	Palladium FUT 09/23 NYM	USD	-366.600,00	60.000,00
Sprzedaż	11	Platinum FUT 10/23 NYM	USD	-502.260,00	-2 815,56
Kupno	11	RUSSELL 2000 FUT 09/23 CME	USD	1.047.035,00	18.182,00
Kupno	1	Redwheat FUT 09/23 MGE	USD	40.850,00	-1 087,50
Kupno	7	Rice FUT 09/23 CBOT	USD	209.790,00	-11 000,00
Kupno	11	S&P 400 MIDCAP FUT 09/23 CME	USD	2.908.510,00	37.755,00
Kupno	19	S&P 500 Index FUT 09/23 CME	USD	4.263.837,50	125.112,88
Sprzedaż	4	Silver FUT 09/23 COMEX	USD	-460.400,00	-1 145,00
Kupno	114	Silver FUT 09/23 COMEX	USD	13.121.400,00	-27 291,03
Kupno	3	Soybean FUT 11/23 CBOT	USD	201.487,50	6.306,25
Sprzedaż	18	Soybean Meal FUT 12/23 CBOT	USD	-715.140,00	5.729,52
Kupno	4	Soybean Oil FUT 12/23 CBOT	USD	141.528,00	7.445,94
Kupno	11	Sugar 11 FUT 10/23 FNX	USD	280.772,80	-38 337,60
Sprzedaż	33	US Dollar CME Term SOFR 1 Month Rate FUT 09/23 CME	USD	-3.125,10	8.415,04
Sprzedaż	21	US Dollar CME Term SOFR 1 Month Rate FUT 10/23 CME	USD	-1.987,97	3.538,35
Sprzedaż	20	US Dollar CME Term SOFR 3 Month Rate FUT 03/24 CME	USD	-1.897,70	35.834,25
Sprzedaż	18	US Dollar CME Term SOFR 3 Month Rate FUT 06/24 CME	USD	-1.714,32	13.086,00
Sprzedaż	40	US Dollar CME Term SOFR 3 Month Rate FUT 09/23 CME	USD	-3.784,00	28.605,00
Sprzedaż	22	US Dollar CME Term SOFR 3 Month Rate FUT 12/23 CME	USD	-2.082,08	34.600,75
Sprzedaż	4	US Dollar Index SPOT FUT 09/23 FNX	USD	-410.348,00	-3 563,00
Kupno	2	US Treasury Bond (Long) FUT 09/23 CBOT	USD	253.812,50	1.166,67
Sprzedaż	11	US Treasury Bond Ultra Long FUT 09/23 CBOT	USD	-1.498.406,25	269,89
Sprzedaż	84	US Treasury Note 10 Years FUT 09/23 CBOT	USD	-9.430.312,92	141.212,86
Sprzedaż	123	US Treasury Note 2 Years FUT 09/23 CBOT	USD	-25.011.282,48	223.145,89
Sprzedaż	187	US Treasury Note 5 Years FUT 09/23 CBOT	USD	-20.026.531,25	280.346,13
Sprzedaż	5	West Texas Intermediate Crude FUT 08/23 ICE	USD	-353.200,00	-4 540,00
Sprzedaż	17	West Texas Intermediate Crude FUT 08/23 NYM	USD	-1.200.880,00	-1 149,50
Sprzedaż	3	West Texas Intermediate Crude FUT 09/23 NYM	USD	-212.340,00	-1 578,00
Kupno	1	West Texas Intermediate Crude FUT 10/23 NYM	USD	70.720,00	286,67
Kupno	5	Wheat 5000 Bushel Hard Red Winter FUT 09/23 CBOT	USD	200.000,00	-16 700,00

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego (cd.)

na dzień 30 czerwca 2023 r.

	Liczba kontraktów	Oznaczenie	Waluta	Ekspozycja (w USD)	Niezrealizowany zysk (w USD)
Kupno	4	Wheat FUT 12/23 CBOT	USD	133.850,00	-17 140,63
Kupno	10	White Sugar FUT 08/23 ICE	USD	316.700,00	-25 715,00
Sprzedaż	4	Zinc FUT 09/23 LME	USD	-238.925,00	9.037,50
Sprzedaż	6	FTSE/JSE AFRICA TOP40 INDEX FUT 09/23 SAF	ZAR	-225.578,02	-1 674,78
					<u>2.339.151,53</u>

SUPERFUND SICAV - SUPERFUND RED

	Liczba kontraktów	Oznaczenie	Waluta	Ekspozycja (w USD)	Niezrealizowany zysk (w USD)
Kupno	2	Canada Govt Bond 6% 10 Year FUT 09/23 MSE	CAD	185.188,54	1.382,91
Kupno	1	Euro Bund 10 Years FUT 09/23 EUX	EUR	145.910,34	-591,34
Kupno	1	French OAT FUT 09/23 EUX	EUR	140.084,40	363,47
Kupno	1	Rapeseed FUT 08/23 MATIF	EUR	24.533,86	-545,50
Kupno	1	Wheat Milling FUT 09/23 MATIF	EUR	12.587,41	-190,93
Kupno	5	FTSE 100 Index FUT 09/23 ICE	GBP	479.413,16	2.180,45
Kupno	2	Korea 10 Years FUT 09/23 KFE	KRW	168.438,39	-500,94
Sprzedaż	7	Korea 3 Years FUT 09/23 KFE	KRW	-551.121,12	1.502,83
Sprzedaż	8	FTSE Bursa Malaysia KLCI Index FUT 07/23 MDE	MYR	-117.878,95	1.017,68
Kupno	2	DOLLAR NEO-ZELANDAIIS FUT 09/23 CME	USD	122.730,00	-1 665,60
Kupno	1	EUR FUT 09/23 CME	USD	136.912,50	1.033,75
Kupno	2	FST Taiwan RIX Capped Price Return TWD Index FUT 07/23 SGX	USD	115.560,00	-300,00
Kupno	3	Gold - Ounce FUT 08/23 COMEX	USD	578.820,00	-14 338,28
Kupno	9	Silver FUT 09/23 COMEX	USD	1.035.900,00	-2 154,56
Kupno	5	US Treasury Note 10 Years FUT 09/23 CBOT	USD	561.328,15	1.171,90
Kupno	6	US Treasury Note 5 Years FUT 09/23 CBOT	USD	642.562,50	-4 757,81
					<u>-16 391,97</u>

Nota 9 - Zmiany w inwestycjach

Zestawienie zmian w inwestycjach za okres sprawozdawczy jest dostępne bezpłatnie w siedzibie Spółki, jak również za pośrednictwem dowolnego agenta płatniczego.

Nota 10 - Zdarzenia w okresie sprawozdawczym

W okresie sprawozdawczym spółka Fuchs Asset Management S.A. zainicjowała proces wykupu menedżerskiego, który jest nadal w toku.

Nota 11 - Zdarzenia po dacie bilansu

Nie wystąpiły istotne zdarzenia po dacie bilansu.

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa

na dzień 30 czerwca 2023 r.

Informacje dotyczące przejrzystości transakcji finansowania papierów wartościowych i ponownego wykorzystania zabezpieczeń gotówkowych (rozporządzenie UE 2015/2365, dalej „SFTR”)

W okresie sprawozdawczym Spółka nie angażowała się w transakcje podlegające wymogom publikacyjnym SFTR. W związku z tym nie należy zgłaszać żadnych informacji dotyczących przejrzystości transakcji finansowania papierów wartościowych i ponownego wykorzystania zabezpieczeń gotówkowych.