

**Niezbadany raport półroczny
na dzień 30 czerwca 2024 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	23

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	FUNDS AVENUE 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 współzarządzający FUNDS AVENUE 49, Boulevard Prince Henri L-1724 LUKSEMBURG Hervé COUSSEMENT Administrator FUNDS AVENUE 49, Boulevard Prince Henri L-1724 LUKSEMBURG
Członkowie Komisji Wykonawczej Zarządzającego alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi	Timothé FUCHS, Prezes Zarządu - Dyrektor współzarządzający Jean-Jacques LAVA, Zastępca Prezesa Zarządu - Dyrektor współzarządzający Lucie FISCHBACH Dyrektor ds. zgodności z przepisami - Dyrektor współzarządzający Michael VERSCHUURE Dyrektor finansowy - Dyrektor współzarządzający
Zarządzający inwestycjami i subdystrybutor	SUPERFUND ASSET MANAGEMENT GMBH 10-12, Marc-Aurel-Strasse A-1010 WIEDEN
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. 2, Rue d'Alsace L-1122 LUKSEMBURG

SUPERFUND SICAV

Organizacja (cd.)

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 2024 r.

Aktywa

Inwestycje

Portfel papierów wartościowych według wartości rynkowej	17.687.622,96
	<hr/>
	17.687.622,96

Środki pieniężne i ich ekwiwalenty

Środki pieniężne w bankach	11.977.152,46
Pozostałe aktywa płynne	39.133.054,77
	<hr/>
	51.110.207,23

Należności

Należne odsetki na rachunkach bankowych	83.963,85
Niezrealizowany zysk na kontraktach typu futures	2.362.668,34
Niezrealizowany zysk na walutowych kontraktach terminowych typu forward	502.384,01
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	16.420,24
	<hr/>
	2.965.436,44

Aktywa ogółem

71.763.266,63

Zobowiązania

Zobowiązania

Pozostałe zobowiązania płynne	11.562.675,29
Zobowiązania z tytułu umorzenia akcji	78.291,12
Niezrealizowana strata na kontraktach typu futures	1.915.803,20
Niezrealizowana strata na walutowych kontraktach terminowych typu forward	335.832,16
Zobowiązania z tytułu kosztów	361.795,12
	<hr/>
	14.254.396,89

Pozostałe zobowiązania

Pozostałe zobowiązania	676.980,43
	<hr/>
	676.980,43

Pasywa ogółem

14.931.377,32

Aktywa netto ogółem na koniec okresu

56.831.889,31

SUPERFUND SICAV - SUPERFUND GREEN

Zestawienie aktywów netto (w USD)

na dzień 30 czerwca 2024 r.

Aktywa

Inwestycje

Portfel papierów wartościowych według wartości rynkowej	16.490.350,15
	<hr/>
	16.490.350,15

Środki pieniężne i ich ekwiwalenty

Środki pieniężne w bankach	10.860.863,76
Pozostałe aktywa płynne	31.686.206,30
	<hr/>
	42.547.070,06

Należności

Należne odsetki na rachunkach bankowych	79.138,96
Niezrealizowany zysk na kontraktach typu futures	2.326.627,50
Niezrealizowany zysk na walutowych kontraktach terminowych typu forward	502.384,01
Rozliczenia międzyokresowe kosztów	15.471,15
	<hr/>
	2.923.621,62

Aktywa ogółem

61.961.041,83

Zobowiązania

Zobowiązania

Pozostałe zobowiązania płynne	6.012.625,78
Zobowiązania z tytułu umorzenia akcji	78.291,12
Niezrealizowana strata na kontraktach typu futures	1.859.510,21
Niezrealizowana strata na walutowych kontraktach terminowych typu forward	335.832,16
Zobowiązania z tytułu kosztów	308.669,36
	<hr/>
	8.594.928,63

Pozostałe zobowiązania

Pozostałe zobowiązania	676.980,43
	<hr/>
	676.980,43

Pasywa ogółem

9.271.909,06

Aktywa netto ogółem na koniec okresu

52.689.132,77

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	14.536,75900	USD	723,32002	10.514.728,86
EUR	18.682,10200	EUR	627,13043	12.554.988,42
Gold	14.134,40400	USD	1.089,98456	15.406.282,19
Silver	11.648,03300	USD	969,91003	11.297.543,98
EUR II	1.203,17000	EUR	665,56376	858.122,65
Euro Gold II	2.159,75000	EUR	888,98948	2.057.466,67
				<hr/>
				52.689.132,77

Załączona informacja stanowi integralną część niniejszego sprawozdania finansowego.

SUPERFUND SICAV - SUPERFUND GREEN

Zestawienie inwestycji i pozostałych aktywów netto (w USD) na dzień 30 czerwca 2024 r.

Waluta	Liczba / wartość nominalna	Opis	Koszt	Wartość rynkowa	% aktywów netto ogółem *
<u>Inwestycje w papiery wartościowe</u>					
<u>Instrumenty rynku pieniężnego</u>					
Instrumenty rynku pieniężnego					
USD	5.000.000	US 0% T-Bills 23/11.07.24	4.892.581,25	4.992.756,00	9,48
Instrumenty rynku pieniężnego ogółem			4.892.581,25	4.992.756,00	9,48
<u>Otwarte fundusze inwestycyjne</u>					
Fundusze inwestycyjne (UCITS)					
EUR	3,49	Istl Cash Series Plc BlackRock ICS EUR Lqy Select Fd Dist	0,00	386,27	0,00
USD	4.103.493,2	Invesco Liquidity Fds Plc US Dollars Ptf USD Dist	4.081.408,91	4.103.493,20	7,79
USD	3.315.963,36	Istl Cash Series Plc BlackRock ICS USD Liquid Fd S USD Dist	3.308.282,91	3.315.963,36	6,29
USD	327.469,73	State Street Liquidity Plc LVNAV Fd I USD Cap	3.632.856,10	4.077.751,32	7,74
			11.022.547,92	11.497.207,88	21,82
Fundusze inwestycyjne (UCITS) ogółem			11.022.547,92	11.497.594,15	21,82
Inwestycje w papiery wartościowe ogółem			15.915.129,17	16.490.350,15	31,30
Środki pieniężne w bankach				10.860.863,76	20,61
Pozostałe aktywa/(pasywa) netto				25.337.918,86	48,09
Ogółem				52.689.132,77	100,00

* 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	21,82 %
Kraje i rządy	9,48 %
Ogółem	<u>31,30 %</u>

Klasyfikacja według terytorium

(według siedziby emitenta)

(w procentach aktywów netto)

Irlandia	21,82 %
Stany Zjednoczone Ameryki	9,48 %
Ogółem	<u>31,30 %</u>

SUPERFUND SICAV - SUPERFUND RED

Zestawienie aktywów netto (w USD)

na dzień 30 czerwca 2024 r.

Aktywa

Inwestycje

Portfel papierów wartościowych według wartości rynkowej 1.197.272,81
1.197.272,81

Środki pieniężne i ich ekwiwalenty

Środki pieniężne w bankach 1.116.288,70
Pozostałe aktywa płynne 7.446.848,47
8.563.137,17

Należności

Należne odsetki na rachunkach bankowych 4.824,89
Niezrealizowany zysk na kontraktach typu futures 36.040,84
Rozliczenia międzyokresowe kosztów 949,09
41.814,82

Aktywa ogółem

9.802.224,80

Zobowiązania

Zobowiązania

Pozostałe zobowiązania płynne 5.550.049,51
Niezrealizowana strata na kontraktach typu futures 56.292,99
Zobowiązania z tytułu kosztów 53.125,76
5.659.468,26

Pasywa ogółem

5.659.468,26

Aktywa netto ogółem na koniec okresu

4.142.756,54

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	748,77986	1.985.848,06
EUR	192,50900	EUR	640,21677	132.072,01
Gold	929,60300	USD	814,93916	757.569,89
Silver	2.342,65100	USD	540,95406	1.267.266,58
				4.142.756,54

Załączona informacja stanowi integralną część niniejszego sprawozdania finansowego.

SUPERFUND SICAV - SUPERFUND RED

Zestawienie inwestycji i pozostałych aktywów netto (w USD)

na dzień 30 czerwca 2024 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	400.000	Invesco Liquidity Fds Plc US Dollars Ptf USD Dist	400.000,00	400.000,00	9,66
USD	350.665,34	Istl Cash Series Plc BlackRock ICS USD Liquid Fd S USD Dist	350.249,21	350.665,34	8,46
USD	35.865,46	State Street Liquidity Plc LVNAV Fd I USD Cap	416.121,55	446.607,47	10,78
Inwestycje w papiery wartościowe ogółem			1.166.370,76	1.197.272,81	28,90
Środki pieniężne w bankach				1.116.288,70	26,95
Pozostałe aktywa/(pasywa) netto				1.829.195,03	44,15
Ogółem				4.142.756,54	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 2024 r.

Klasyfikacja według branży

(w procentach aktywów netto)

Fundusze inwestycyjne	<u>28,90 %</u>
Ogółem	<u>28,90 %</u>

Klasyfikacja według terytorium

(według siedziby emitenta)

(w procentach aktywów netto)

Irlandia	<u>28,90 %</u>
Ogółem	<u>28,90 %</u>

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego

na dzień 30 czerwca 2024 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.

Spółka FUNDS AVENUE działa jako Zarządzający alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi Spółki.

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.

Sposób prezentacji sprawozdania finansowego jest zgodny z opisanym w art. 104 Rozporządzenia Delegowanego Komisji (UE) nr 231/2013.

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 upływająca opcji i kontraktów terminowych typu forward niebędących przedmiotem obrotu na giełdach lub innych Rynkach regulowanych oznacza, że ich wartość upływająca netto określona, zgodnie z politykami ustanowionymi przez Zarząd, na podstawie konsekwentnie stosowanej dla każdego innego rodzaju kontraktów. Wartość upływająca 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 upływającej 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 2024 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. Zrealizowane zyski i straty z walutowych kontraktów terminowych typu forward odpowiadają różnicy między wartością kontraktu w momencie jego otwarcia a wartością zamknięcia. Niezrealizowane zyski i straty z otwartych kontraktów 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. Zrealizowane zyski i straty na kontraktach typu futures ustala się przy użyciu metody FIFO (First In, First Out). Niezrealizowane zyski i straty z otwartych kontraktów 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	=	1,4974543	AUD	Dolar australijski
			5,5550000	BRL	Real brazylijski
			1,3682500	CAD	Dolar kanadyjski
			0,8985500	CHF	Frank szwajcarski
			944,1497648	CLP	Peso chilijskie
			7,3007500	CNH	Juan chiński za granicą
			4.144,6654012	COP	Peso kolumbijskie
			0,9331840	EUR	Euro
			0,7910454	GBP	Funt szterling
			7,8075500	HKD	Dolar hongkoński
			16.374,9201723	IDR	Rupia indonezyjska
			83,3475024	INR	Rupia indyjska
			160,8649904	JPY	Jen japoński
			1.378,2058792	KRW	Won południowokoreański
			4,7175000	MYR	Ringgit malezyjski
			1,6409583	NZD	Dolar nowozelandzki
			3,8304000	PEN	Nowy sol peruwiański
			58,4899988	PHP	Peso filipińskie
			10,5937000	SEK	Korona szwedzka
			1,3553500	SGD	Dolar singapurski
			36,7200006	THB	Bat tajlandzki
			32,4569998	TWD	Dolar nowozelandzki
			18,2474999	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 2024 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.

Nota 4 - Opłaty dla ZAFI

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 skryzalizowała 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 (wzrost 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 skryzalizowała 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.

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego (cd.)

na dzień 30 czerwca 2024 r.

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 - SUPERFUND GREEN

Waluta	Kupno	Waluta	Sprzedaż	Termin zapadalności	Niezrealizowany wynik (w USD)
Terminowe kontrakty walutowe typu forward (ADM Investor Services Inc, Stany Zjednoczone Ameryki)					
AUD	300.000,00	CAD	274.203,00	18.09.2024	-33,07
AUD	2.000.000,00	CAD	1.815.680,00	18.09.2024	8.798,41
AUD	100.000,00	JPY	10.568.780,00	18.09.2024	424,30
AUD	100.000,00	JPY	10.501.860,00	18.09.2024	840,30
AUD	200.000,00	JPY	21.113.800,00	18.09.2024	996,29
AUD	100.000,00	JPY	10.436.780,00	18.09.2024	1.244,86
AUD	2.300.000,00	JPY	237.661.070,00	18.09.2024	43.457,10
AUD	100.000,00	JPY	10.478.380,00	18.09.2024	986,26
AUD	1.000.000,00	NZD	1.095.510,00	18.09.2024	1.538,44
AUD	1.000.000,00	NZD	1.093.683,00	18.09.2024	2.651,81
CAD	91.191,00	AUD	100.000,00	18.09.2024	-142,46
CAD	173.953,40	GBP	100.000,00	18.09.2024	879,33
CAD	345.530,00	GBP	200.000,00	18.09.2024	21,57
CAD	200.000,00	JPY	23.238.280,00	18.09.2024	255,44
CAD	700.000,00	JPY	79.702.910,00	18.09.2024	11.033,40
CAD	2.300.000,00	JPY	261.880.990,00	18.09.2024	36.252,61
CAD	100.000,00	JPY	11.583.980,00	18.09.2024	346,29
CAD	200.000,00	JPY	23.109.460,00	18.09.2024	1.056,23
CAD	100.000,00	JPY	11.531.920,00	18.09.2024	669,91
CAD	100.000,00	JPY	11.401.770,00	18.09.2024	1.478,98
CAD	100.000,00	JPY	11.260.500,00	18.09.2024	2.357,17
CHF	100.000,00	EUR	103.096,72	18.09.2024	1.441,23
CHF	500.000,00	EUR	518.510,84	18.09.2024	3.962,16
CHF	600.000,00	EUR	625.703,92	18.09.2024	1.013,73
CHF	100.000,00	EUR	103.909,81	18.09.2024	569,93
CHF	400.000,00	GBP	359.553,79	18.09.2024	-5.430,18
CHF	300.000,00	GBP	266.477,17	18.09.2024	-42,30
CHF	300.000,00	GBP	266.832,70	18.09.2024	-491,75
CHF	100.000,00	GBP	89.409,69	18.09.2024	-752,32
CHF	100.000,00	GBP	88.884,94	18.09.2024	-88,96
CHF	100.000,00	JPY	17.473.100,00	18.09.2024	2.395,26
CHF	200.000,00	JPY	35.678.740,00	18.09.2024	236,76
CHF	2.200.000,00	JPY	382.304.780,00	18.09.2024	65.771,41
CHF	100.000,00	JPY	17.811.230,00	18.09.2024	293,31
CHF	400.000,00	USD	457.335,20	18.09.2024	-7.978,01
CHF	100.000,00	USD	112.976,48	18.09.2024	-637,18
CHF	100.000,00	USD	112.785,35	18.09.2024	-446,05
CHF	400.000,00	USD	454.039,82	18.09.2024	-4.682,63
CHF	300.000,00	USD	341.456,20	18.09.2024	-4.438,31
CZK	3.000.000,00	EUR	121.881,86	18.09.2024	-2.546,34
EUR	1.235.472,90	CHF	1.200.000,00	18.09.2024	-19.103,35
EUR	103.692,81	CHF	100.000,00	18.09.2024	-802,46
EUR	120.038,41	CZK	3.000.000,00	18.09.2024	570,90
EUR	602.557,01	CZK	15.000.000,00	18.09.2024	5.388,78
EUR	602.244,93	CZK	15.000.000,00	18.09.2024	5.054,36
EUR	100.000,00	GBP	84.708,70	18.09.2024	415,59
EUR	100.000,00	GBP	84.819,20	18.09.2024	275,90
EUR	100.000,00	GBP	84.745,70	18.09.2024	368,81
EUR	100.000,00	GBP	84.658,00	18.09.2024	479,68
EUR	50.473,19	HUF	20.000.000,00	18.09.2024	156,91
EUR	402.617,01	HUF	160.000.000,00	18.09.2024	3,14
EUR	403.785,49	HUF	160.000.000,00	18.09.2024	1.255,28
EUR	50.748,54	HUF	20.000.000,00	18.09.2024	451,98
EUR	50.188,21	HUF	20.000.000,00	18.09.2024	-148,47
EUR	100.030,01	HUF	40.000.000,00	18.09.2024	-668,15
EUR	1.100.000,00	JPY	185.557.240,00	18.09.2024	15.735,91
EUR	100.000,00	JPY	16.834.230,00	18.09.2024	1.645,69
EUR	53.383,16	SEK	600.000,00	18.09.2024	555,37
GBP	1.500.000,00	CAD	2.600.740,50	18.09.2024	-6.933,55
GBP	1.056.623,58	CHF	1.200.000,00	18.09.2024	-11.568,52
GBP	1.538.780,40	EUR	1.800.000,00	18.09.2024	10.247,68

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego (cd.)

na dzień 30 czerwca 2024 r.

Waluta	Kupno	Waluta	Sprzedaż	Termin zapadalności	Niezrealizowany wynik (w USD)
GBP	84.890,00	EUR	100.000,00	18.09.2024	-186,40
GBP	84.795,00	EUR	100.000,00	18.09.2024	-306,49
GBP	200.000,00	JPY	39.967.580,00	18.09.2024	1.539,24
GBP	100.000,00	JPY	20.116.890,00	18.09.2024	-57,78
GBP	1.700.000,00	JPY	335.308.000,00	18.09.2024	40.537,74
HUF	480.000.000,00	EUR	1.220.908,03	18.09.2024	-14.001,30
HUF	20.000.000,00	EUR	50.377,83	18.09.2024	-54,72
HUF	60.000.000,00	USD	166.389,35	18.09.2024	-3.992,52
JPY	10.400.050,00	AUD	100.000,00	18.09.2024	-1.473,19
JPY	20.439.780,00	AUD	200.000,00	18.09.2024	-5.186,26
JPY	10.282.930,00	AUD	100.000,00	18.09.2024	-2.201,26
JPY	10.571.650,00	AUD	100.000,00	18.09.2024	-406,46
JPY	10.265.570,00	AUD	100.000,00	18.09.2024	-2.309,17
JPY	22.425.740,00	CAD	200.000,00	18.09.2024	-5.306,51
JPY	11.489.160,00	CAD	100.000,00	18.09.2024	-935,73
JPY	11.370.350,00	CAD	100.000,00	18.09.2024	-1.674,30
JPY	22.635.860,00	CAD	200.000,00	18.09.2024	-4.000,32
JPY	11.245.300,00	CAD	100.000,00	18.09.2024	-2.451,66
JPY	11.330.330,00	CAD	100.000,00	18.09.2024	-1.923,08
JPY	17.397.960,00	CHF	100.000,00	18.09.2024	-2.862,36
JPY	17.466.000,00	CHF	100.000,00	18.09.2024	-2.439,40
JPY	17.377.730,00	CHF	100.000,00	18.09.2024	-2.988,12
JPY	35.572.860,00	CHF	200.000,00	18.09.2024	-894,95
JPY	16.732.100,00	EUR	100.000,00	18.09.2024	-2.280,57
JPY	16.787.080,00	EUR	100.000,00	18.09.2024	-1.938,79
JPY	19.748.300,00	GBP	100.000,00	18.09.2024	-2.233,52
JPY	19.712.450,00	GBP	100.000,00	18.09.2024	-2.456,37
JPY	19.625.000,00	GBP	100.000,00	18.09.2024	-3.000,00
JPY	19.559.550,00	GBP	100.000,00	18.09.2024	-3.406,86
JPY	19.734.310,00	GBP	100.000,00	18.09.2024	-2.320,48
JPY	10.000.000,00	USD	64.664,23	18.09.2024	-1.758,64
JPY	10.000.000,00	USD	64.687,66	18.09.2024	-1.782,07
JPY	10.000.000,00	USD	64.931,73	18.09.2024	-2.026,14
JPY	10.000.000,00	USD	64.371,44	18.09.2024	-1.465,85
MXN	2.500.000,00	USD	140.821,27	18.09.2024	-5.771,08
MXN	1.000.000,00	USD	54.654,96	18.09.2024	-634,88
MXN	500.000,00	USD	26.801,03	18.09.2024	209,01
NOK	7.200.000,00	EUR	631.468,16	18.09.2024	-1.775,84
NOK	600.000,00	EUR	53.059,78	18.09.2024	-616,74
NZD	2.170.162,00	AUD	2.000.000,00	18.09.2024	-15.787,74
PLN	3.200.000,00	USD	810.845,05	18.09.2024	-15.603,21
SEK	600.000,00	EUR	53.139,67	18.09.2024	-294,45
SEK	1.800.000,00	EUR	160.339,21	18.09.2024	-1.869,43
SEK	600.000,00	EUR	52.725,84	18.09.2024	149,01
SEK	3.600.000,00	EUR	316.591,23	18.09.2024	640,99
SEK	4.800.000,00	EUR	420.978,78	18.09.2024	2.079,34
SEK	1.200.000,00	EUR	106.279,34	18.09.2024	-588,89
SEK	2.400.000,00	USD	230.884,67	18.09.2024	-3.435,13
SGD	200.000,00	USD	148.925,87	18.09.2024	-820,34
SGD	200.000,00	USD	148.564,13	18.09.2024	-458,60
USD	200.423,70	AUD	300.000,00	18.09.2024	-314,18
USD	735.942,40	CAD	1.000.000,00	18.09.2024	3.743,97
USD	1.347.755,82	CHF	1.200.000,00	18.09.2024	-315,75
USD	112.593,59	CHF	100.000,00	18.09.2024	254,29
USD	391.202,30	CZK	9.000.000,00	18.09.2024	5.575,43
USD	390.913,43	CZK	9.000.000,00	18.09.2024	5.286,56
USD	877.963,13	DKK	6.000.000,00	18.09.2024	11.874,24
USD	872.320,16	EUR	800.000,00	18.09.2024	11.826,56
USD	379.515,00	GBP	300.000,00	18.09.2024	52,66
USD	379.242,00	GBP	300.000,00	18.09.2024	-220,34
USD	272.553,83	HUF	100.000.000,00	18.09.2024	1.892,45
USD	107.296,14	HUF	40.000.000,00	18.09.2024	-968,41
USD	272.553,83	HUF	100.000.000,00	18.09.2024	1.892,45
USD	55.263,89	HUF	20.000.000,00	18.09.2024	1.131,61
USD	544.217,69	ILS	2.000.000,00	18.09.2024	11.170,34
USD	63.355,70	JPY	10.000.000,00	18.09.2024	450,11
USD	63.522,88	JPY	10.000.000,00	18.09.2024	617,29
USD	840.417,62	JPY	130.000.000,00	18.09.2024	22.644,91
USD	64.092,29	JPY	10.000.000,00	18.09.2024	1.186,70

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego (cd.)

na dzień 30 czerwca 2024 r.

Waluta	Kupno	Waluta	Sprzedaż	Termin zapadalności	Niezrealizowany wynik (w USD)
USD	125.629,80	JPY	20.000.000,00	18.09.2024	-181,39
USD	136.918,78	MXN	2.500.000,00	18.09.2024	1.868,59
USD	79.872,20	MXN	1.500.000,00	18.09.2024	-1.157,91
USD	295.828,81	PLN	1.200.000,00	18.09.2024	-2.386,88
USD	296.076,98	PLN	1.200.000,00	18.09.2024	-2.138,71
USD	101.587,30	PLN	400.000,00	18.09.2024	2.182,07
USD	229.379,72	SEK	2.400.000,00	18.09.2024	1.930,18
USD	297.675,08	SGD	400.000,00	18.09.2024	1.464,02
USD	1.190.700,33	SGD	1.600.000,00	18.09.2024	5.856,09
USD	148.495,74	SGD	200.000,00	18.09.2024	390,21
USD	149.323,94	SGD	200.000,00	18.09.2024	1.218,41
USD	188.471,96	ZAR	3.500.000,00	18.09.2024	-2.214,16
USD	26.329,65	ZAR	500.000,00	18.09.2024	-911,22
USD	209.638,11	ZAR	4.000.000,00	18.09.2024	-8.288,88
USD	27.147,36	ZAR	500.000,00	18.09.2024	-93,51
USD	182.993,14	ZAR	3.500.000,00	18.09.2024	-7.692,98
USD	80.956,36	ZAR	1.500.000,00	18.09.2024	-766,26
ZAR	4.000.000,00	USD	217.158,33	18.09.2024	768,66
ZAR	4.000.000,00	USD	217.863,74	18.09.2024	63,25
ZAR	4.000.000,00	USD	221.033,55	18.09.2024	-3.106,56
ZAR	3.500.000,00	USD	194.629,34	18.09.2024	-3.943,22
ZAR	500.000,00	USD	27.633,47	18.09.2024	-392,60
ZAR	500.000,00	USD	27.105,85	18.09.2024	135,02
					144.205,25
Terminowe kontrakty walutowe typu forward (Fcstone LLC, Stany Zjednoczone Ameryki)					
THB	4.000.000,00	USD	109.589,04	18.08.2024	-713,92
BRL	300.000,00	USD	55.049,91	18.09.2024	-1.865,54
BRL	300.000,00	USD	56.669,00	18.09.2024	-3.484,63
COP	3.300.000.000,00	USD	838.201,68	18.09.2024	-51.940,54
IDR	1.000.000.000,00	USD	61.005,37	18.09.2024	86,75
IDR	1.000.000.000,00	USD	60.853,16	18.09.2024	238,96
IDR	1.000.000.000,00	USD	60.957,03	18.09.2024	135,09
IDR	1.000.000.000,00	USD	61.342,17	18.09.2024	-250,05
INR	390.000.000,00	USD	4.680.187,21	18.09.2024	-13.370,46
PHP	6.000.000,00	USD	101.936,80	18.09.2024	643,30
TWD	3.000.000,00	USD	93.254,59	18.09.2024	-602,34
TWD	12.000.000,00	USD	374.882,85	18.09.2024	-4.273,85
TWD	3.000.000,00	USD	93.167,70	18.09.2024	-515,45
TWD	3.000.000,00	USD	92.506,94	18.09.2024	145,31
USD	391.280,04	BRL	2.100.000,00	18.09.2024	18.989,46
USD	565.642,85	BRL	3.000.000,00	18.09.2024	33.799,17
USD	82.888,96	CNH	600.000,00	18.09.2024	199,09
USD	75.071,51	COP	300.000.000,00	18.09.2024	3.593,22
USD	280.841,03	COP	1.200.000.000,00	18.09.2024	-5.072,11
USD	222.386,95	COP	900.000.000,00	18.09.2024	7.952,09
USD	222.606,98	COP	900.000.000,00	18.09.2024	8.172,12
USD	60.701,71	IDR	1.000.000.000,00	18.09.2024	-390,41
USD	61.263,25	IDR	1.000.000.000,00	18.09.2024	171,13
USD	1.288.343,56	IDR	21.000.000.000,00	18.09.2024	5.409,12
USD	61.207,00	IDR	1.000.000.000,00	18.09.2024	114,88
USD	60.764,42	IDR	1.000.000.000,00	18.09.2024	-327,70
USD	551.267,92	IDR	9.000.000.000,00	18.09.2024	1.438,87
USD	4.648.812,05	INR	390.000.000,00	18.09.2024	-18.004,70
USD	527.788,04	PEN	2.000.000,00	18.09.2024	4.550,43
USD	527.788,04	PEN	2.000.000,00	18.09.2024	4.550,43
USD	203.438,10	PHP	12.000.000,00	18.09.2024	-1.722,09
USD	101.936,80	PHP	6.000.000,00	18.09.2024	-643,30
USD	101.919,48	PHP	6.000.000,00	18.09.2024	-660,62
USD	1.740.851,99	PHP	102.000.000,00	18.09.2024	-3.009,66
USD	101.815,71	PHP	6.000.000,00	18.09.2024	-764,39
USD	204.429,30	PHP	12.000.000,00	18.09.2024	-730,89
USD	101.789,80	PHP	6.000.000,00	18.09.2024	-790,30
USD	204.498,98	PHP	12.000.000,00	18.09.2024	-661,21
USD	109.950,52	THB	4.000.000,00	18.09.2024	1.075,40
USD	109.289,62	THB	4.000.000,00	18.09.2024	414,50
USD	109.430,14	THB	4.000.000,00	18.09.2024	555,02
USD	92.307,69	TWD	3.000.000,00	18.09.2024	-344,56
USD	1.950.404,01	TWD	63.000.000,00	18.09.2024	4.706,75
USD	93.225,61	TWD	3.000.000,00	18.09.2024	573,36

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego (cd.)

na dzień 30 czerwca 2024 r.

Waluta	Kupno	Waluta	Sprzedaż	Termin zapadalności	Niezrealizowany wynik (w USD)
USD	92.936,80	TWD	3.000.000,00	18.09.2024	284,55
USD	92.939,68	TWD	3.000.000,00	18.09.2024	287,43
USD	92.936,80	TWD	3.000.000,00	18.09.2024	284,55
USD	92.879,26	TWD	3.000.000,00	18.09.2024	227,01
USD	92.532,62	TWD	3.000.000,00	18.09.2024	-119,63
CNH	600.000,00	USD	83.200,44	19.09.2024	-504,29
CNH	600.000,00	USD	82.717,55	19.09.2024	-21,40
CNH	600.000,00	USD	83.194,68	19.09.2024	-498,53
CNH	600.000,00	USD	83.391,24	19.09.2024	-695,09
USD	166.761,63	CNH	1.200.000,00	19.09.2024	1.369,32
USD	82.877,51	CNH	600.000,00	19.09.2024	181,36
USD	82.866,06	CNH	600.000,00	19.09.2024	169,91
USD	83.275,50	CNH	600.000,00	19.09.2024	579,35
USD	83.053,03	CNH	600.000,00	19.09.2024	356,88
USD	165.325,69	CNH	1.200.000,00	19.09.2024	-66,62
USD	3.665.546,64	CNH	26.400.000,00	19.09.2024	26.915,86
USD	72.592,12	KRW	100.000.000,00	19.09.2024	-145,30
USD	730.433,51	KRW	1.000.000.000,00	19.09.2024	3.059,33
USD	72.292,47	KRW	100.000.000,00	19.09.2024	-444,95
USD	193.423,60	CLP	180.000.000,00	23.09.2024	2.082,97
USD	193.008,79	CLP	180.000.000,00	23.09.2024	1.668,16
					22.346,60

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)
Kupno	81	Australian 90 Day Bank Bill FUT 09/24 SFE	AUD	53.498.190,10	-17.079,25
Kupno	46	Australian 90 Day Bank Bill FUT 12/24 SFE	AUD	30.380.947,27	-10.006,34
Kupno	2	Australian T-Bonds 10 Year FUT 09/24 SFE	AUD	151.682,72	-1.168,21
Sprzedaż	6	Australian T-Bonds 3 Year FUT 09/24 SFE	AUD	-422.544,27	-154,38
Kupno	19	S&P/ASX 200 Index FUT 09/24 SFE	AUD	2.465.317,26	4.440,87
Kupno	59	Canada Govt Bond 6% 10 Year FUT 09/24 MSE	CAD	5.177.511,42	-86.161,15
Sprzedaż	101	Canadian Overnight Repo Rate Average CORRA FUT 09/24 MSE	CAD	-7.050,99	4.056,28
Sprzedaż	8	Canadian Overnight Repo Rate Average CORRA FUT 12/24 MSE	CAD	-559,87	219,26
Sprzedaż	53	Canola FUT 11/24 WCE	CAD	-485.822,04	-292,34
Kupno	7	S&P TSX 60 Index FUT 09/24 MSE	CAD	1.340.909,92	8.081,86
Sprzedaż	29	SIX Swiss Exchange SARON Swiss Average Rate Overnight FUT 09/24 ICE	CHF	-7.985.045,35	-3.450,00
Sprzedaż	19	SIX Swiss Exchange SARON Swiss Average Rate Overnight FUT 12/24 ICE	CHF	-5.236.603,42	-6.677,42
Kupno	2	Swiss Federal Bond 6% 10 Year FUT 09/24 EUX	CHF	332.135,11	5.942,91
Kupno	8	CAC 40 Index FUT 07/24 MONEP	EUR	642.317,04	-11.641,86
Kupno	6	DAX Germany Index FUT 09/24 EUX	EUR	2.958.098,22	12.001,92

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego (cd.)

na dzień 30 czerwca 2024 r.

	Liczba kontraktów	Oznaczenie	Waluta	Ekspozycja (w USD)	Niezrealizowany wynik (w USD)
Sprzedaż	35	EURIBOR 3 Months BASE 365 FUT 03/25 ICE	EUR	-9.086.766,15	-3.884,55
Sprzedaż	26	EURIBOR 3 Months BASE 365 FUT 06/25 ICE	EUR	-6.761.662,05	-3.509,49
Sprzedaż	21	EURIBOR 3 Months BASE 365 FUT 09/25 ICE	EUR	-5.468.093,51	-5.116,89
Sprzedaż	54	EURIBOR 3 Months BASE 365 FUT 12/24 ICE	EUR	-13.989.202,20	-1.151,97
Sprzedaż	11	Emission CO2 Carbon Dioxide FUT 12/24 ICE	EUR	-795.309,37	50.375,92
Kupno	10	Euro BTP 10 Years FUT 09/24 EUX	EUR	1.235.447,64	-14.616,62
Kupno	3	Euro BUXL 30 Years FUT 09/24 EUX	EUR	418.695,55	-9.472,94
Kupno	49	Euro Bund 10 Years FUT 09/24 EUX	EUR	6.911.155,61	-44.514,92
Sprzedaż	246	Euro Stoxx 50 EUR (Price) Index FUT 09/24 EUX	EUR	-12.985.605,94	60.605,66
Kupno	12	Euro Stoxx 50 Volatility VSTOXX Index FUT 07/24 EUX	EUR	20.831,90	-1.201,94
Kupno	95	Euro Stoxx Banks EUR Price Index FUT 09/24 EUX	EUR	700.143,26	-794,59
Sprzedaż	30	Euro-BOBL 5 Years FUT 09/24 EUX	EUR	-3.743.313,12	-15.212,13
Sprzedaż	54	Euro-Schatz 6% 2 Years FUT 09/24 EUX	EUR	-6.116.478,48	-14.113,27
Sprzedaż	64	FTSE MIB Index FUT 09/24 MIL	EUR	-11.441.601,79	44.396,39
Sprzedaż	24	French OAT FUT 09/24 EUX	EUR	-3.166.449,41	7.269,75
Kupno	19	IBEX 35 Index FUT 07/24 MEFF	EUR	2.214.397,10	-27.856,24
Sprzedaż	79	Maize FUT 08/24 MATIF	EUR	-879.368,36	57.973,56
Sprzedaż	42	Rapeseed FUT 08/24 MATIF	EUR	-1.073.984,31	-10.689,21
Sprzedaż	94	Wheat Milling FUT 09/24 MATIF	EUR	-1.131.957,87	91.661,99
Kupno	23	BBG Calc SONIA Coup 3M Tenor ISDA Fallback Rates FUT 03/25 ICE	GBP	6.941.036,80	-2.386,08
Kupno	18	BBG Calc SONIA Coup 3M Tenor ISDA Fallback Rates FUT 06/25 ICE	GBP	5.443.208,67	-4.945,99
Kupno	47	BBG Calc SONIA Coup 3M Tenor ISDA Fallback Rates FUT 09/24 ICE	GBP	14.117.758,57	237,03
Kupno	37	BBG Calc SONIA Coup 3M Tenor ISDA Fallback Rates FUT 12/24 ICE	GBP	11.140.874,94	-3.587,03
Kupno	3	Cocoa FUT 09/24 LIFFE	GBP	241.351,52	-63.675,24
Sprzedaż	45	EUR FUT 09/24 CME	GBP	-6.044.572,73	-16.923,81
Kupno	28	FTSE 100 Index FUT 09/24 ICE	GBP	2.906.735,94	-13.317,82
Kupno	5	Long Gilt Fut 10 Years FUT 09/24 ICE	GBP	616.715,58	-9.443,20
Sprzedaż	159	Hang Seng China Enterprises Index FUT 07/24 HKFE	HKD	-6.379.305,92	111.404,99
Kupno	1	Hang Seng Index FUT 07/24 HKFE	HKD	112.903,54	-2.625,66
Kupno	32	EUR FUT 09/24 CME	JPY	4.248.780,29	68.690,65
Kupno	29	Gold - Ounce FUT 02/25 OSE	JPY	2.173.219,91	115.985,46
Kupno	28	Gold - Ounce FUT 04/25 OSE	JPY	2.099.151,59	54.213,16
Kupno	2	Japan Govt Bond 6% 10 Year FUT 09/24 OSE	JPY	1.776.147,81	497,31

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego (cd.)

na dzień 30 czerwca 2024 r.

	Liczba kontraktów	Oznaczenie	Waluta	Ekspozycja (w USD)	Niezrealizowany wynik (w USD)
Kupno	7	Nikkei 225 Index FUT 09/24 CME	JPY	865.725,97	11.344,92
Sprzedaż	364	Nikkei 225 Index FUT 09/24 OSE	JPY	-8.956.031,99	-160.118,74
Sprzedaż	85	Nikkei 225 Index FUT 09/24 SGX	JPY	-10.464.831,39	-197.665,76
Kupno	20	Platinum FUT 02/25 OSE	JPY	320.703,71	1.756,13
Kupno	85	Platinum FUT 04/25 OSE	JPY	1.364.840,17	33.938,40
Kupno	30	Rubber FUT 11/24 OSE	JPY	305.380,31	-12.451,44
Kupno	15	TOPIX Index (TOKYO) FUT 09/24 OSE	JPY	2.620.675,88	11.189,51
Kupno	29	KOREA KOSPI 200 FUT 09/24 KSE	KRW	2.032.379,59	30.002,77
Kupno	81	Korea 10 Years FUT 09/24 KFE	KRW	6.736.453,63	21.252,27
Kupno	290	Korea 3 Years FUT 09/24 KFE	KRW	22.136.025,15	34.000,73
Kupno	271	FTSE Bursa Malaysia KLCI Index FUT 07/24 MDE	MYR	4.585.601,49	17.795,44
Kupno	55	Palm oil 1 Ton (1000 Kg) Crude FUT 09/24 MDE	MYR	1.141.388,45	-4.552,20
Kupno	50	OMX Stockholm 30 Index FUT 07/24 OMX	SEK	1.216.760,91	-1.377,71
Kupno	40	MSCI Singapore Free IndexSM (The) FUT 07/24 SGX	SGD	933.633,38	10.414,28
Sprzedaż	129	30 Day Fed Fd FUT 08/24 CBOT	USD	-50.902.634,39	-734,38
Sprzedaż	56	30 Day Fed Fd FUT 10/24 CBOT	USD	-22.132.270,44	-4.208,70
Sprzedaż	44	30 Day Fed Fd FUT 11/24 CBOT	USD	-17.402.475,42	-7.342,02
Kupno	18	AUD FUT 09/24 CME	USD	1.202.940,00	1.202,60
Kupno	6	Aluminum Primary FUT 09/24 LME	USD	378.534,00	-112.041,00
Kupno	29	Brent Crude FUT 09/24 ICE	USD	2.465.000,00	39.040,00
Kupno	28	Brent Crude FUT 09/24 NYM	USD	2.380.000,00	-6.160,00
Kupno	18	Brent Crude FUT 10/24 ICE	USD	1.515.420,00	-4.640,00
Sprzedaż	14	CAD FUT 09/24 CME	USD	-1.024.800,00	-3.161,00
Sprzedaż	27	CBOE SPX Volatility Index FUT 07/24 CBF	USD	-378.615,60	10.014,40
Sprzedaż	7	CHF FUT 09/24 CME	USD	-982.887,50	6.703,88
Kupno	20	Cattle Feeder FUT 08/24 CME	USD	2.593.000,00	7.636,65
Kupno	3	Cocoa FUT 09/24 FXN	USD	231.930,00	-48.500,00
Kupno	7	Coffee 'C' FUT 09/24 FXN	USD	595.350,00	-1.087,50
Kupno	18	Coffee Robusta FUT 09/24 LIFFE	USD	721.980,00	-5.130,00
Kupno	2	Copper FUT 09/24 COMEX	USD	219.575,00	475,00
Kupno	1	Copper FUT 09/24 LME	USD	239.803,75	-68.646,25
Sprzedaż	158	Corn FUT 12/24 CBOT	USD	-3.323.925,00	196.964,44
Sprzedaż	19	Cotton FUT 12/24 FXN	USD	-690.555,00	-6.910,00
Kupno	8	DJ Industrial Average Index FUT 09/24 CBOT	USD	1.578.760,00	-3.298,00
Sprzedaż	75	DOLLAR NEO-ZELANDAIIS FUT 09/24 CME	USD	-4.571.250,00	28.523,30
Sprzedaż	19	EUR FUT 09/24 CME	USD	-2.553.600,00	22.216,00
Kupno	94	EUR FUT 09/24 CME	USD	12.633.600,00	-37.139,25
Kupno	6	EUR FUT 09/24 CME	USD	806.400,00	-2.394,00
Kupno	9	FC Orange Juice-A FUT 09/24 FXN	USD	557.820,00	-12.405,00
Kupno	40	FST Taiwan RIX Capped Price Return TWD Index FUT 07/24 SGX	USD	3.086.000,00	22.560,00
Sprzedaż	75	FTSE XINHUA CHINA A 50 Index FUT 07/24 SGX	USD	-892.650,00	6.618,00
Kupno	16	GBP FUT 09/24 CME	USD	1.264.900,00	-14.528,13

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego (cd.)

na dzień 30 czerwca 2024 r.

	Liczba kontraktów	Oznaczenie	Waluta	Ekspozycja (w USD)	Niezrealizowany wynik (w USD)
Kupno	14	Gas Oil FUT 07/24 ICE	USD	1.099.700,00	37.850,00
Kupno	15	Gas Oil FUT 08/24 ICE	USD	1.176.000,00	31.925,00
Kupno	8	Gasoline FUT 08/24 NYM	USD	840.504,00	10.372,32
Kupno	9	Gasoline FUT 09/24 NYM	USD	934.038,00	-4.863,60
Kupno	29	Gold - Ounce FUT 08/24 COMEX	USD	6.784.840,00	-71.737,93
Kupno	66	Gold - Ounce FUT 08/24 COMEX	USD	15.441.360,00	-170.148,85
Kupno	9	Gold - Ounce FUT 08/24 COMEX	USD	2.105.640,00	-23.467,69
Sprzedaż	39	JPY FUT 09/24 CME	USD	-3.067.593,75	69.008,50
Kupno	5	Lead FUT 09/24 LME	USD	278.631,25	-11.831,25
Sprzedaż	47	Lean Hogs FUT 08/24 CME	USD	-1.682.600,00	85.793,20
Kupno	26	Live Cattle FUT 08/24 CME	USD	1.928.420,00	60.565,80
Kupno	11	Live Cattle FUT 10/24 CME	USD	813.450,00	28.045,12
Sprzedaż	30	Lumber FUT 09/24 CME	USD	-396.825,00	21.499,59
Kupno	26	MXN FUT 09/24 CME	USD	700.440,00	6.440,00
Kupno	3	NY Harbor ULSD FUT 08/24 NYM	USD	319.170,60	-2.390,85
Kupno	16	NY Harbor ULSD FUT 09/24 NYM	USD	1.712.860,80	-13.231,43
Kupno	7	Nasdaq 100 Stock Index FUT 09/24 CME	USD	2.789.815,00	-3.405,00
Sprzedaż	9	Natural Gas FUT 08/24 NYM	USD	-234.090,00	14.714,48
Sprzedaż	5	Natural Gas FUT 09/24 NYM	USD	-129.900,00	6.940,00
Sprzedaż	4	Natural Gas FUT 10/24 NYM	USD	-107.680,00	5.936,00
Sprzedaż	10	Natural Gas FUT 11/24 NYM	USD	-308.100,00	11.050,00
Kupno	3	Oats FUT 12/24 CBT	USD	48.487,50	1.428,75
Sprzedaż	1	Platinum FUT 10/24 NYM	USD	-50.705,00	-43,50
Sprzedaż	2	RUSSELL 2000 FUT 09/24 CME	USD	-206.500,00	-2.320,00
Sprzedaż	36	Redwheat FUT 09/24 MGE	USD	-1.103.400,00	100.987,50
Sprzedaż	12	Rice FUT 09/24 CBOT	USD	-369.360,00	6.085,00
Kupno	1	S&P 400 MIDCAP FUT 09/24 CME	USD	295.810,00	-1.050,00
Kupno	12	S&P 500 Index FUT 09/24 CME	USD	3.312.900,00	5.952,75
Kupno	2	Silver FUT 09/24 COMEX	USD	295.600,00	-512,50
Kupno	77	Silver FUT 09/24 COMEX	USD	11.380.600,00	114.168,21
Sprzedaż	41	Soybean FUT 11/24 CBOT	USD	-2.263.200,00	16.509,70
Sprzedaż	14	Soybean Meal FUT 12/24 CBOT	USD	-469.700,00	5.262,22
Sprzedaż	43	Soybean Oil FUT 12/24 CBOT	USD	-1.129.782,00	-5.031,36
Sprzedaż	21	Sugar 11 FUT 10/24 FNX	USD	-477.456,00	-17.886,40
Sprzedaż	218	US Dollar CME Term SOFR 1 Month Rate FUT 08/24 CME	USD	-20.644,60	9.023,83
Sprzedaż	112	US Dollar CME Term SOFR 1 Month Rate FUT 09/24 CME	USD	-10.612,00	5.797,96
Sprzedaż	74	US Dollar CME Term SOFR 1 Month Rate FUT 10/24 CME	USD	-7.018,16	20,12
Sprzedaż	36	US Dollar CME Term SOFR 3 Month Rate FUT 03/25 CME	USD	-3.435,66	-5.951,00
Sprzedaż	25	US Dollar CME Term SOFR 3 Month Rate FUT 06/25 CME	USD	-2.392,13	1.992,50
Sprzedaż	144	US Dollar CME Term SOFR 3 Month Rate FUT 09/24 CME	USD	-13.658,40	-1.899,00

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego (cd.)

na dzień 30 czerwca 2024 r.

	Liczba kontraktów	Oznaczenie	Waluta	Ekspozycja (w USD)	Niezrealizowany wynik (w USD)
Sprzedaż	57	US Dollar CME Term SOFR 3 Month Rate FUT 12/24 CME	USD	-5.423,27	-6.057,00
Kupno	19	US Dollar Index SPOT FUT 09/24 FNX	USD	2.005.355,00	16.600,00
Kupno	92	US Treasury Bond (Long) FUT 09/24 CBOT	USD	10.884.750,00	-79.080,14
Kupno	151	US Treasury Note 10 Years FUT 09/24 CBOT	USD	16.607.641,38	-185,66
Sprzedaż	41	US Treasury Note 2 Years FUT 09/24 CBOT	USD	-8.372.969,16	-23.698,06
Kupno	101	US Treasury Note 5 Years FUT 09/24 CBOT	USD	10.764.391,13	9.936,99
Kupno	15	West Texas Intermediate Crude FUT 08/24 ICE	USD	1.223.100,00	32.560,00
Kupno	33	West Texas Intermediate Crude FUT 08/24 NYM	USD	2.690.820,00	77.781,67
Kupno	17	West Texas Intermediate Crude FUT 09/24 NYM	USD	1.370.880,00	43.070,00
Kupno	13	West Texas Intermediate Crude FUT 10/24 NYM	USD	1.036.880,00	20.320,00
Sprzedaż	18	Wheat 5000 Bushel Hard Red Winter FUT 09/24 CBOT	USD	-527.625,00	-2.563,77
Sprzedaż	36	Wheat FUT 12/24 CBOT	USD	-1.074.600,00	-12.062,10
Sprzedaż	3	White Sugar FUT 08/24 ICE	USD	-89.760,00	-4.265,00
Kupno	5	Zinc FUT 09/24 LME	USD	366.933,75	-18.503,75
Sprzedaż	21	FTSE/JSE AFRICA TOP40 INDEX FUT 09/24 SAF	ZAR	-848.654,34	123,85
					467.117,29

SUPERFUND SICAV - SUPERFUND RED

	Liczba kontraktów	Oznaczenie	Waluta	Ekspozycja (w USD)	Niezrealizowany wynik (w USD)
Kupno	13	Canada Govt Bond 6% 10 Year FUT 09/24 MSE	CAD	1.140.807,60	-17.789,15
Kupno	1	Euro BUXL 30 Years FUT 09/24 EUX	EUR	139.565,18	-2.186,06
Kupno	1	Euro Bund 10 Years FUT 09/24 EUX	EUR	141.043,99	772,46
Sprzedaż	14	Euro Stoxx 50 EUR (Price) Index FUT 09/24 EUX	EUR	-739.018,22	3.318,12
Sprzedaż	4	FTSE MIB Index FUT 09/24 MIL	EUR	-715.100,11	2.577,20
Sprzedaż	1	French OAT FUT 09/24 EUX	EUR	-131.935,39	302,91
Sprzedaż	1	Rapeseed FUT 08/24 MATIF	EUR	-25.571,06	-428,64
Sprzedaż	2	Wheat Milling FUT 09/24 MATIF	EUR	-24.084,21	709,94
Sprzedaż	5	Hang Seng China Enterprises Index FUT 07/24 HKFE	HKD	-200.607,10	3.650,31
Kupno	2	Hang Seng Index FUT 07/24 HKFE	HKD	225.807,07	-1.652,25
Kupno	1	Japan Govt Bond 6% 10 Year FUT 09/24 OSE	JPY	888.073,90	248,66
Sprzedaż	23	Nikkei 225 Index FUT 09/24 OSE	JPY	-565.903,12	-10.114,07
Sprzedaż	4	Nikkei 225 Index FUT 09/24 SGX	JPY	-492.462,65	-9.122,56
Kupno	3	Korea 10 Years FUT 09/24 KFE	KRW	249.498,28	914,23
Kupno	20	Korea 3 Years FUT 09/24 KFE	KRW	1.526.622,42	1.625,30
Kupno	8	FTSE Bursa Malaysia KLCI Index FUT 07/24 MDE	MYR	135.368,31	577,64

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego (cd.)

na dzień 30 czerwca 2024 r.

	Liczba kontraktów	Oznaczenie	Waluta	Ekspozycja (w USD)	Niezrealizowany wynik (w USD)
Kupno	1	Brent Crude FUT 09/24 ICE	USD	85.000,00	560,00
Kupno	1	Brent Crude FUT 09/24 NYM	USD	85.000,00	-220,00
Kupno	1	Cattle Feeder FUT 08/24 CME	USD	129.650,00	2.587,50
Sprzedaż	3	DOLLAR NEO-ZELANDAIIS FUT 09/24 CME	USD	-182.850,00	1.213,90
Kupno	1	EUR FUT 09/24 CME	USD	134.400,00	-399,00
Kupno	2	FST Taiwan RIX Capped Price Return TWD Index FUT 07/24 SGX	USD	154.300,00	1.060,00
Kupno	3	Gold - Ounce FUT 08/24 COMEX	USD	701.880,00	-7.822,56
Kupno	1	NY Harbor ULSD FUT 09/24 NYM	USD	107.053,80	-485,27
Kupno	2	S&P 500 Index FUT 09/24 CME	USD	552.150,00	-1.025,00
Kupno	9	Silver FUT 09/24 COMEX	USD	1.330.200,00	13.550,27
Kupno	11	US Treasury Bond (Long) FUT 09/24 CBOT	USD	1.301.437,50	-4.478,43
Kupno	27	US Treasury Note 10 Years FUT 09/24 CBOT	USD	2.969.578,26	306,29
Kupno	21	US Treasury Note 5 Years FUT 09/24 CBOT	USD	2.238.140,73	2.066,11
Kupno	1	West Texas Intermediate Crude FUT 08/24 NYM	USD	81.540,00	-570,00
					<u>-20.252,15</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

Nie wystąpiły istotne zdarzenia.

Nota 11 - Zdarzenia po dacie bilansu

Nie wystąpiły istotne zdarzenia po dacie bilansu.

SUPERFUND SICAV

Informacja dodatkowa

na dzień 30 czerwca 2024 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.