

Warszawa, 25 sierpnia 2021 r.

Szanowni Państwo,

W imieniu AgioFunds Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych S.A. przekazujemy Państwu sprawozdanie finansowe BETA ETF WIG20short Portfelowego Funduszu Inwestycyjnego Zamkniętego (dalej „Fundusz”) za okres sprawozdawczy od 1 stycznia 2021 r. do 30 czerwca 2021 r.

W sprawozdaniu finansowym zawarte są szczegółowe informacje na temat składu portfela lokat, struktury kosztów oraz rezultaty operacji finansowych. Do sprawozdania finansowego załączony jest raport niezależnego biegłego rewidenta z przeglądu półrocznego sprawozdania finansowego, oraz oświadczenie banku depozytariusza o zgodności stanu aktywów Funduszu.

Na koniec okresu sprawozdawczego wartość aktywów netto na jeden certyfikat inwestycyjny Funduszu (dalej „Certyfikat”) wynosiła 317,90 zł według wyceny bilansowej, co oznaczało spadek o 47,59 zł, czyli o -13,02% w stosunku do ceny emisyjnej na poziomie 365,49 zł ustalonej na dzień 31 grudnia 2020 r. W rozpatrywanym okresie kursy akcji kontynuowały zapoczątkowany w połowie marca 2020 roku trend wzrostowy, który nastąpił po wcześniejszym gwałtownym załamaniu rynków akcji spowodowanym wybuchem pandemii COVID-19. Z racji polityki inwestycyjnej Funduszu polegającej na odzwierciedlaniu indeksu WIG20short, który jest indeksem ujemnie skorelowanym z indeksem akcji WIG20, wycena Certyfikatów w okresie sprawozdawczym pozostawała w trendzie spadkowym. W pierwszym półroczu 2021r. najwyższa wycena aktywów netto na Certyfikat wynosząca 383,44 zł miała miejsce w dniu 25 marca 2021r., natomiast najniższą wycenę aktywów netto na Certyfikat odnotowano w dniu 28 czerwca 2021 r., kiedy wartość ta wyniosła 308,64 zł.

Wartość aktywów netto na dzień 30 czerwca 2021. wynosiła 18 539 tys. zł, co odpowiadało 58 317 Certyfikatów. W porównaniu do analogicznych wartości na koniec poprzedniego roku obrotowego wynoszących odpowiednio 20 766 tys. zł i 56 817 Certyfikatów, aktywa netto spadły w okresie sprawozdawczym o -10,73%, co spowodowane było przede wszystkim spadkiem wartości aktywów netto na Certyfikat o -13,02%. W okresie tym wyemitowano łącznie 1 500 Certyfikatów, natomiast nie dokonano żadnych wykupów.

W całym okresie sprawozdawczym nie wystąpiły przypadki wystąpienia trudności w realizacji strategii inwestycyjnej określonej w statucie i nie miały miejsca naruszenia limitów inwestycyjnych tam określonych. Stopa zwrotu certyfikatu inwestycyjnego w okresie sprawozdawczym wyniosła -13,02% przy stopie zwrotu indeksu równej -12,03%, co odpowiadało wartości różnicy odwzorowania na poziomie -0,99%. Wartość błędu odwzorowania dla tego okresu wyniosła średnio 4,69%. Łączna ekspozycja netto Funduszu na indeks WIG20 wynosiła w tym okresie przeciętnie -100,06% i wahała się w przedziale pomiędzy -101,71% a -98,96%.

Dziękujemy Państwu za możliwość kontynuacji zarządzania Państwa środkami poprzez nasz Fundusz. Jednocześnie zachęcamy Państwa do zapoznania się z informacjami zawartymi w niniejszym sprawozdaniu. Zawarte w nim informacje pozwolą Państwu w pełni poznać realizowaną politykę inwestycyjną.

Mariusz Jagodziński
Prezes Zarządu

*/podpisano kwalifikowanym
podpisem elektronicznym/*

Wojciech Somerski
Wiceprezes Zarządu

*/podpisano kwalifikowanym
podpisem elektronicznym/*

Marcin Grabowski
Członek Zarządu

*/podpisano kwalifikowanym
podpisem elektronicznym/*