

Warszawa, 24 sierpnia 2020 r.

Szanowni Państwo,

W imieniu AgioFunds Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych S.A. przekazujemy Państwu sprawozdanie finansowe BETA ETF WIG20TR Portfelowego Funduszu Inwestycyjnego Zamkniętego (dalej „Fundusz”) za okres sprawozdawczy od 1 stycznia 2020 r. do 30 czerwca 2020 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 29,90 zł według wyceny bilansowej, co oznaczało spadek o 6,80 zł, czyli o - 18,53% w stosunku do wartości aktywów netto na Certyfikat na dzień 31 grudnia 2019 r., tj. na koniec poprzedniego roku obrotowego, wynoszącej 36,70 zł. W rozpatrywanym okresie, pod koniec lutego, miało miejsce załamanie na rynkach akcji spowodowane wybuchem pandemii COVID-19, które w dniu 12 marca 2020r. doprowadziło do tego, iż Certyfikaty zanotowały swoją najniższą historycznie wycenę aktywów netto na Certyfikat wynoszącą 22,24 zł, tracąc w ten sposób w relacji do 31 grudnia 2019r. - 39,40%. Pomimo znaczącej poprawy sytuacji na rynkach akcji po dniu 12 marca 2020r., Certyfikatom nie udało się osiągnąć poziomów sprzed wybuchu pandemii. W całym okresie sprawozdawczym maksymalna wartość aktywów netto na Certyfikat wynosiła 37,55 zł i miała miejsce w dniu 2 stycznia 2020r., natomiast maksymalna wartość aktywów netto na Certyfikat po historycznym minimum to jedynie 31,34 zł z 5 czerwca 2020r., co odpowiadało spadkowi o -16,54% w relacji do najwyższej wartości z okresu sprawozdawczego i jednocześnie wzrostowi o 40,92% w stosunku do historycznego minimum z 12 marca 2020r.

Wartość aktywów netto na dzień 30 czerwca 2020r. wynosiła 46 288 tys. zł, co odpowiadało 1 547 913 Certyfikatom. W porównaniu do analogicznych wartości na koniec poprzedniego roku obrotowego wynoszących odpowiednio 30 108 tys. zł i 820 315 Certyfikatów, aktywa netto wzrosły w okresie sprawozdawczym o ponad 53,7%, co spowodowane było przede wszystkim silnym wzrostem liczby Certyfikatów o 88,7%. W okresie tym wyemitowano łącznie 790 000 Certyfikatów, natomiast wykupiono 62 402 Certyfikaty.

W całym okresie sprawozdawczym nie wystąpiły przypadki wystąpienia trudności w realizacji strategii inwestycyjnej określonej w statucie i nie miały miejsca jakiegokolwiek naruszenia limitów inwestycyjnych tam określonych. Stopa zwrotu certyfikatu inwestycyjnego w okresie sprawozdawczym wyniosła wspomniane -18,53% przy stopie zwrotu indeksu równej -18,10%, co odpowiadało wartości różnicy odwzorowania na poziomie -0,43%. Wartość błędu odwzorowania dla całego okresu sprawozdawczego wyniosła zaś zaledwie 0,06%. Łączna ekspozycja netto Funduszu wynosiła w tym okresie przeciętnie 100,00% i wahała się w przedziale pomiędzy 99,41% a 100,08%, czyli w przedziale znacząco niższym od statutowego wynoszącego od 95% do 105%.

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/*