

Warszawa, 30 sierpnia 2022 r.

Szanowni Państwo,

W imieniu AgioFunds Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych S.A. przekazujemy Państwu sprawozdanie finansowe BETA ETF TBSP Portfelowego Funduszu Inwestycyjnego Zamkniętego (dalej „Fundusz”) za okres sprawozdawczy od 15 listopada 2021 r. do 30 czerwca 2022 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 173,29 zł według wyceny bilansowej, co oznaczało spadek o 18,62 zł, czyli o -9,70% w stosunku do wartości aktywów netto na Certyfikat na dzień 17 stycznia 2022 r., tj. dzień debiutu Funduszu na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie, wynoszącej 191,91 zł. W rozpatrywanym okresie kurs Certyfikatów znajdował się w trendzie spadkowym wywołanym wzrostem niepewności na rynkach finansowych w związku z eskalacją konfliktu na Ukrainie oraz późniejszą inwazją wojskową Federacji Rosyjskiej na terytorium Ukrainy. W całym okresie sprawozdawczym maksymalna wartość aktywów netto na Certyfikat wynosiła 193,32 zł i miała miejsce w dniu 21 stycznia 2022r., natomiast minimalna wartość aktywów netto na Certyfikat wyniosła 166,97 zł i miała miejsce w dniu 20 czerwca 2022 r. Wartość aktywów netto na dzień 30 czerwca 2022 r. wynosiła 20 523 tys. zł, co odpowiadało 118 429 Certyfikatom. W porównaniu do analogicznych wartości na dzień 17 stycznia 2022 roku tj. dzień debiutu Funduszu na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie wynoszących odpowiednio 5 263 tys. zł i 27 429 Certyfikatów, aktywa netto wzrosły w okresie sprawozdawczym o 289,88%, natomiast liczba Certyfikatów wzrosła o 331,77%. W całym okresie sprawozdawczym wyemitowano łącznie 118 429 Certyfikatów oraz nie dokonano wykupu Certyfikatów.

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 od 17 stycznia 2022 roku tj. debiutu Funduszu na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie wyniosła wspomniane -9,70% przy stopie zwrotu indeksu równej -9,34%, co odpowiadało wartości różnicy odwzorowania (Tracking Difference) na poziomie -0,36%. Wartość błędu odwzorowania (Tracking Error) dla okresu od debiutu na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie tj. 17 stycznia 2022 roku do 30 czerwca 2022 roku wyniosła 1,179%. Łączna ekspozycja netto Funduszu w okresie od debiutu na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie tj. 17 stycznia 2022 roku do 30 czerwca 2022 roku wynosiła w tym okresie przeciętnie 99,34% i wahała się w przedziale pomiędzy 96,44% a 99,76%.

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/*