

Warszawa, 30 sierpnia 2022 r.

Szanowni Państwo,

W imieniu AgioFunds Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych S.A. przekazujemy Państwu sprawozdanie finansowe BETA ETF mWIG40TR Portfelowego Funduszu Inwestycyjnego Zamkniętego (dalej „Fundusz”) za okres sprawozdawczy od 1 stycznia 2022 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 58,95 zł według wyceny bilansowej, co oznaczało spadek o 16,49 zł, czyli o -21,86% w stosunku do wartości aktywów netto na Certyfikat na dzień 31 grudnia 2021 r., tj. na koniec poprzedniego roku obrotowego, wynoszącej 75,44 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 79,07 zł i miała miejsce w dniu 12 stycznia 2022r., natomiast minimalna wartość aktywów netto na Certyfikat wyniosła 56,90 zł i miała miejsce w dniu 17 czerwca 2022 r. Wartość aktywów netto na dzień 30 czerwca 2022 r. wynosiła 161 209 tys. zł, co odpowiadało 2 734 603 Certyfikatom. W porównaniu do analogicznych wartości na koniec poprzedniego roku obrotowego wynoszących odpowiednio 187 588 tys. zł i 2 486 603 Certyfikatów, aktywa netto spadły w okresie sprawozdawczym o -14,06%, natomiast liczba Certyfikatów wzrosła o 9,97%. W okresie tym wyemitowano łącznie 258 000 Certyfikatów oraz dokonano wykupu 10 000 Certyfikatów.

W całym okresie sprawozdawczym nie wystąpiły przypadki 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 wspomniane -21,86% przy stopie zwrotu indeksu równej -21,40%, co odpowiadało wartości różnicy odwzorowania (Tracking Difference) na poziomie -0,46%. Wartość błędu odwzorowania (Tracking Error) dla całego okresu sprawozdawczego wyniosła 0,128%. Łączna ekspozycja netto Funduszu wynosiła w tym okresie przeciętnie 99,91% i wahała się w przedziale pomiędzy 98,99% a 100,46%, 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/*