

Warszawa, 30 sierpnia 2022 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 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 375,32 zł według wyceny bilansowej, co oznaczało wzrost o 77,54 zł, czyli o 26,04% w stosunku do wartości aktywów netto na Certyfikat na dzień 31 grudnia 2021 r., tj. na koniec poprzedniego roku obrotowego, wynoszącej 297,78 zł. W rozpatrywanym okresie kurs Certyfikatów znajdował się w dość trendzie wzrostowym 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 385,72 zł i miała miejsce w dniu 23 czerwca 2022r., natomiast minimalna wartość aktywów netto na Certyfikat wyniosła 280,27 zł i miała miejsce w dniu 12 stycznia 2022 r. Wartość aktywów netto na dzień 30 czerwca 2022 r. wynosiła 21 212 tys. zł, co odpowiadało 56 517 Certyfikatom. W porównaniu do analogicznych wartości na koniec poprzedniego roku obrotowego wynoszących odpowiednio 20 045 tys. zł i 67 317 Certyfikatów, aktywa netto wzrosły w okresie sprawozdawczym o 5,82%, natomiast liczba Certyfikatów spadła o 16,04%. W okresie tym wyemitowano łącznie 25 700 Certyfikatów oraz dokonano wykupu 36 500 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 sprawozdawczym wyniosła wspomniane 26,04% przy stopie zwrotu indeksu równej 31,17%, co odpowiadało wartości różnicy odwzorowania (Tracking Difference) na poziomie -5,19%. Wartość błędu odwzorowania (Tracking Error) dla całego okresu sprawozdawczego wyniosła 6,11%. Łączna ekspozycja netto Funduszu wynosiła w tym okresie przeciętnie -99,95% i wahała się w przedziale pomiędzy -102,41% a -98,92%.

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/*