

Warszawa, 13 kwietnia 2021 r.

Szanowni Państwo,

W imieniu AgioFunds Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych S.A. przekazujemy Państwu sprawozdanie finansowe BETA ETF WIG20lev Portfelowego Funduszu Inwestycyjnego Zamkniętego (dalej „Fundusz”) za okres sprawozdawczy od 7 stycznia 2020r. do 31 grudnia 2020 r.

W sprawozdaniu finansowym zawarte są szczegółowe informacje na temat składu portfela lokat, struktury kosztów oraz rezultaty operacji finansowych. Do sprawozdania finansowego załączone jest sprawozdanie niezależnego biegłego rewidenta z badania rocznego 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 39,87 zł według wyceny bilansowej, co oznacza spadek o 12,36 zł (-23,66%) w stosunku do wartości z dnia 4 lutego 2020r. (czyli od pierwszego dnia zainwestowania środków) wynoszącej 52,01 zł. Celem inwestycyjnym Funduszu jest odwzorowywanie stóp zwrotu indeksu odniesienia WIG20lev, który w analogicznym okresie spadł o -20,84% co oznacza, że różnica odwzorowania wyniosła -2,51%. Fundusz pobiera opłatę za zarządzanie w wysokości 1,00%, więc w porównaniu do funduszy segmentu akcji polskich jest to opłata relatywnie niska.

BETA ETF WIG20lev cieszył się pewnym zainteresowaniem inwestorów. Wartość aktywów netto Funduszu od dnia 4 lutego 2020r. do dnia 31 grudnia 2020r. uległa zwiększeniu o 2,82 mln zł i na koniec roku wyniosła 7,83 mln zł. W tym samym okresie na GPW obrót Certyfikatami wyniósł 90,85 mln zł., natomiast liczba transakcji wyniosła 10 838. W okresie tym liczba Certyfikatów wzrosła o 100 000 z poziomu 96 500 do 196 500, co daje wzrost liczby wyemitowanych Certyfikatów o ok. 103,6%.

Polityka inwestycyjna BETA ETF WIG20lev opiera się na stosowaniu syntetycznej oraz fizycznej replikacji indeksu WIG20 (Indeks Bazowy) z uwzględnieniem stopnia dźwigni finansowej replikowanego indeksu WIG20lev. Polega ona na zawieraniu odpowiednich długich pozycji w kontraktach futures na WIG20 (syntetyczna replikacja) oraz nabywaniu akcji wchodzących w skład indeksu WIG20 (fizyczna replikacja) w celu uzyskania dwukrotnej ekspozycji na WIG20 (Indeks Bazowy). Od 4 lutego 2020r. do końca grudnia 2020 r. średni poziom ekspozycji na Indeks Bazowy kształtował się na poziomie 200,06%, gdzie średni poziom ekspozycji syntetycznej wynosił ok. 137,17%, natomiast replikacji fizycznej ok. 62,89%. W całym okresie sprawozdawczym nie wystąpiły trudności w realizacji strategii inwestycyjnej określonej w statucie.

Dziękujemy Państwu za możliwość kontynuacji zarządzania Państwa środkami poprzez BETA ETF WIG20lev. Jednocześnie zachęcamy Państwa do zapoznania się z informacjami zawartymi w niniejszym sprawozdaniu. Zawarte w nim informacje pozwolą Państwu w pełni poznać realizowaną politykę inwestycyjną.

Z poważaniem,

Mariusz Jagodziński
Prezes Zarządu

*/podpisano kwalifikowanym
podpisem elektronicznym/*

Wojciech Somerski
Wiceprezes Zarządu

*/podpisano kwalifikowanym
podpisem elektronicznym/*

Marcin Grabowski
Członek Zarządu

*/podpisano kwalifikowanym
podpisem elektronicznym/*