

Warszawa, 13 kwietnia 2021 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 01 stycznia 2020 r. 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 33,76 zł według wyceny bilansowej, co oznacza spadek o 2,94 zł (-8,01%) w stosunku do wyceny na 31 grudnia 2019r. wynoszącej 36,70 zł. Celem inwestycyjnym Funduszu jest odwzorowywanie stóp zwrotu indeksu odniesienia WIG20TR, który w analogicznym okresie stracił - 7,17% co oznacza, że różnica odwzorowania wyniosła -0,85%, z czego znaczna jej część to rekordowo niska jak na fundusze akcji polskich opłata za zarządzanie wynosząca aktualnie 0,40% w skali roku.

BETA ETF WIG20TR cieszył się dużym zainteresowaniem inwestorów. W trakcie 2020 roku wartość aktywów netto Funduszu uległa zwiększeniu o 22,48 mln zł i na dzień 31 grudnia 2020 roku wyniosła 52,59 mln zł. W 2020 roku na GPW obrót Certyfikatami wyniósł 95,45 mln zł. Natomiast liczba transakcji wyniosła 16 031. W całym 2020 roku liczba Certyfikatów wzrosła o 737 598 z poziomu 820 315 do 1 557 913 co daje wzrost liczby wyemitowanych Certyfikatów o ok. 90%.

Polityka inwestycyjna BETA ETF WIG20TR opiera się na stosowaniu replikacji fizycznej polegającej na bezpośrednich inwestycjach w akcje spółek z indeksu WIG20TR. W okresie sprawozdawczym średni poziom ekspozycji z tytułu akcji kształtował się na poziomie 99,55%. Uzupełnieniem fizycznych zakupów akcji była długa pozycja w kontraktach futures na WIG20 (replikacja syntetyczna), która średnio w tym samym okresie stanowiła 0,40% łącznej ekspozycji na WIG20TR. W związku z tym średnia łączna ekspozycja Funduszu na indeks WIG20TR w 2020r. wyniosła 99,95%. W całym okresie sprawozdawczym nie wystąpiły istotne trudności w realizacji strategii inwestycyjnej określonej w statucie.

Dziękujemy Państwu za możliwość kontynuacji zarządzania Państwa środkami poprzez BETA ETF WIG20TR. 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/*