

Warszawa, 18 sierpnia 2022 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 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 29,21 zł według wyceny bilansowej, co oznaczało spadek o 9,88 zł, czyli o -25,28% w stosunku do wartości aktywów netto na Certyfikat na dzień 31 grudnia 2021 r., tj. na koniec poprzedniego roku obrotowego, wynoszącej 39,09 zł. W rozpatrywanym okresie kurs Certyfikatów znajdował się w dość dynamicznym 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 41,57 zł i miała miejsce w dniu 12 stycznia 2022r., natomiast minimalna wartość aktywów netto na Certyfikat wyniosła 28,50 zł i miała miejsce w dniu 23 czerwca 2022 r. Wartość aktywów netto na dzień 30 czerwca 2022 r. wynosiła 66 774 tys. zł, co odpowiadało 2 285 700 Certyfikatom. W porównaniu do analogicznych wartości na koniec poprzedniego roku obrotowego wynoszących odpowiednio 65 748 tys. zł i 1 681 913 Certyfikatów, aktywa netto wzrosły w okresie sprawozdawczym o 1,56%, co w kontekście dużych spadków aktywów netto na Certyfikat wynikało z jeszcze większego wzrostu liczby Certyfikatów o 35,90%. W okresie tym wyemitowano łącznie 948 000 Certyfikatów oraz dokonano wykupu 344 213 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 -25,28% przy stopie zwrotu indeksu równej -24,88%, co odpowiadało wartości różnicy odwzorowania (Tracking Difference) na poziomie -0,40%. Wartość błędu odwzorowania (Tracking Error) dla całego okresu sprawozdawczego wyniosła 0,06%. Łączna ekspozycja netto Funduszu wynosiła w tym okresie przeciętnie 100,01% i wahała się w przedziale pomiędzy 99,46% a 100,17%, 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/*