

Warszawa, 25 sierpnia 2021 r.

Szanowni Państwo,

W imieniu AgioFunds Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych S.A. przekazujemy Państwu sprawozdanie finansowe BETA ETF Nasdaq-100 PLN-Hedged Portfelowego Funduszu Inwestycyjnego Zamkniętego (dalej „Fundusz”) za okres sprawozdawczy od 18 grudnia 2020 r. do 30 czerwca 2021 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 142,60 zł według wyceny bilansowej, co oznaczało wzrost o 7,40 zł, czyli o 5,47% w stosunku do ceny emisyjnej Certyfikatów serii A wynoszącej 135,20 zł. W całym okresie sprawozdawczym maksymalna wartość aktywów netto na Certyfikat wynosiła 142,72 zł i miała miejsce w dniu 29 czerwca 2021r., natomiast minimalna wartość aktywów netto na Certyfikat wyniosła 120,83 zł w dniu 8 marca 2021r. Wartość aktywów netto na dzień 30 czerwca 2021. wynosiła 5 818 tys. zł, co odpowiadało 40 800 Certyfikatom. W porównaniu do analogicznych wartości na pierwszy dzień wyceny z dnia 5 stycznia 2021r., wynoszących odpowiednio 4 830 tys. zł i 35 800 Certyfikatów, aktywa netto wzrosły o 20,46%, co spowodowane było przede wszystkim wzrostem liczby Certyfikatów o 13,97%. W okresie sprawozdawczym wyemitowano łącznie 5 000 Certyfikatów, natomiast nie miały miejsce wykupy Certyfikatów.

Faktyczną działalność inwestycyjną, ze względu na opóźnienia wynikłe po stronie sądu rejestrowego, rozpoczął w dniu 4 lutego 2021r. natomiast ukończenie budowy portfela, zgodnie z polityką inwestycyjną Funduszu, nastąpiło w dniu 11 lutego 2021r. Z wyłączeniem początkowego okresu budowania portfela inwestycyjnego w okresie sprawozdawczym nie miały miejsca naruszenia limitów inwestycyjnych określonych w statucie ani też nie wystąpiły przypadki wystąpienia trudności w realizacji strategii inwestycyjnej. Stopa zwrotu z certyfikatu inwestycyjnego wyliczona w PLN w okresie od 11 lutego, czyli pierwszego dnia wdrożenia w pełni strategii inwestycyjnej, do 30 czerwca 2021r. wyniosła 5,54% przy zmianie indeksu wyrażonej w USD o 6,18%, co odpowiadało wartości różnicy odwzorowania na poziomie -0,64%. Wartość błędu odwzorowania dla tego samego okresu wyniosła średnio 0,75%, natomiast łączna ekspozycja netto Funduszu wynosiła przeciętnie 100,11%, wahając się w przedziale pomiędzy 99,38% a 102,44%, czyli w przedziale niższym od statutowego wynoszącego od 95% do 105%.

Ponadto oświadczamy, iż według naszej najlepszej wiedzy, półroczne skrócone sprawozdanie finansowe i dane porównywalne zostały sporządzone zgodnie z obowiązującymi zasadami rachunkowości oraz że odzwierciedlają w sposób prawdziwy, rzetelny i jasny sytuację majątkową i finansową Funduszu oraz jego wynik z operacji, oraz że półroczne sprawozdanie z działalności emitenta zawiera prawdziwy obraz rozwoju i osiągnięć oraz sytuacji Funduszu, w tym opis podstawowych zagrożeń i ryzyka.

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/*