

Warszawa, 13 kwietnia 2021 r.

Szanowni Państwo,

W imieniu AgioFunds Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych S.A. przekazujemy Państwu sprawozdanie finansowe BETA ETF mWIG40TR 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 55,63 zł według wyceny bilansowej, co oznacza wzrost o 1,45 zł (+2,68%) w stosunku do wartości z dnia 31 grudnia 2019r. wynoszącej 54,18 zł. Celem inwestycyjnym Funduszu jest odwzorowywanie stóp zwrotu indeksu odniesienia mWIG40TR, który w analogicznym okresie zyskał 3,58% co oznacza, że różnica odwzorowania wyniosła -0,90%. Fundusz pobiera opłatę za zarządzanie w wysokości 0,80%, więc w porównaniu do innych funduszy segmentu akcji polskich jest to opłata niska.

BETA ETF mWIG40TR cieszył się bardzo dużym zainteresowaniem inwestorów. Wartość aktywów netto Funduszu w 2020r. uległa zwiększeniu o 50,40 mln zł i na koniec roku wyniosła 128,86 mln zł. W 2020 roku na GPW obrót Certyfikatami wyniósł 96,58 mln zł. Natomiast liczba transakcji wyniosła 19 893. W całym 2020 roku liczba Certyfikatów wzrosła o 868 113 z poziomu 1 448 100 do 2 316 213 co daje wzrost liczby wyemitowanych Certyfikatów o ok. 60%.

Polityka inwestycyjna BETA ETF mWIG40TR opiera się na stosowaniu replikacji fizycznej polegającej na bezpośrednich inwestycjach w akcje spółek z indeksu mWIG40TR. Od 1 stycznia 2020r. do końca grudnia 2020 r. średni poziom ekspozycji z tytułu akcji ukształtował się na poziomie 99,49%. Uzupełnieniem fizycznych zakupów akcji jest długa pozycja w kontraktach futures na mWIG40 (replikacja syntetyczna), która średnio w tym samym okresie stanowiła 0,47% łącznej ekspozycji na mWIG40TR. W związku z tym średnia łączna ekspozycja Funduszu na indeks mWIG40TR w 2020r. wyniosła 99,96%. 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 mWIG40TR. 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/*