

Warszawa, 30 sierpnia 2022 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 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 111,76 zł według wyceny bilansowej, co oznaczało spadek o 48,21 zł, czyli o -30,14% w stosunku do wartości aktywów netto na Certyfikat na dzień 31 grudnia 2021 r., tj. na koniec poprzedniego roku obrotowego, wynoszącej 159,97 zł. W rozpatrywanym okresie kurs Certyfikatów znajdował się w 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 161,58 zł i miała miejsce w dniu 3 stycznia 2022r., natomiast minimalna wartość aktywów netto na Certyfikat wyniosła 109,29 zł i miała miejsce w dniu 20 czerwca 2022 r. Wartość aktywów netto na dzień 30 czerwca 2022 r. wynosiła 11 980 tys. zł, co odpowiadało 107 200 Certyfikatom. W porównaniu do analogicznych wartości na koniec poprzedniego roku obrotowego wynoszących odpowiednio 10 750 tys. zł i 67 200 Certyfikatów, aktywa netto wzrosły w okresie sprawozdawczym o 11,45%, natomiast liczba Certyfikatów wzrosła o 59,52%. W okresie tym wyemitowano łącznie 40 000 Certyfikatów oraz nie dokonano wykupu Certyfikatów.

W całym okresie sprawozdawczym nie wystąpiły przypadki 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 -30,14% przy stopie zwrotu indeksu równej -29,31%, co odpowiadało wartości różnicy odwzorowania (Tracking Difference) na poziomie -0,83%. Wartość błędu odwzorowania (Tracking Error) dla całego okresu sprawozdawczego wyniosła 1,406%. Łączna ekspozycja netto Funduszu wynosiła w tym okresie przeciętnie 100,02% i wahała się w przedziale pomiędzy 94,81% a 102,56%. Minimalna wartość ekspozycji w okresie sprawozdawczym wynosząca 94,81% z dnia 30 maja 2022 roku miała związek z technicznymi aspektami księgowymi a nie z ekonomicznymi. Różnice między aspektami księgowymi a ekonomicznymi wynikały z dnia wolnego od sesji giełdowej w Stanach Zjednoczonych (30 maja 2022 rok).

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/*